

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF） 2016 年半年度报告

2016 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	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 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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情况.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	42
§11 备查文件目录.....	45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	华夏蓝筹混合（LOF）
场内简称	华夏蓝筹
基金主代码	160311
交易代码	160311
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2007 年 4 月 24 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,439,722,685.68 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	2007 年 5 月 28 日

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	本基金将结合宏观经济环境、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，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	汤嵩彦
	联系电话	400-818-6666	95559
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-818-6666	95559

传真	010-63136700	021-62701216
注册地址	北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	上海市浦东新区银城中路 188 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	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	100033	200120
法定代表人	杨明辉	牛锡明

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》、《上海证券报》、《证券时报》
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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-376,982,401.87
本期利润	-668,731,258.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1928
本期加权平均净值利润率	-15.84%
本期基金份额净值增长率	-13.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	2,823,130,301.47
期末可供分配基金份额利润	0.8207
期末基金资产净值	4,297,730,942.40
期末基金份额净值	1.249
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	84.25%

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	2.13%	0.94%	-0.15%	0.59%	2.28%	0.35%
过去三个月	0.73%	1.09%	-0.87%	0.61%	1.60%	0.48%
过去六个月	-13.44%	1.83%	-8.40%	1.10%	-5.04%	0.73%
过去一年	-19.11%	2.08%	-15.87%	1.38%	-3.24%	0.70%
过去三年	61.79%	1.59%	34.87%	1.10%	26.92%	0.49%
自基金转型以来至今	84.25%	1.51%	21.16%	1.16%	63.09%	0.35%

3.2.2 自基金转型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

华夏蓝筹核心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

（2007年4月24日至2016年6月30日）



注：自2007年4月24日起，由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。

§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，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 2016 年 6 月 30 日数据），华夏策略混合在 75 只灵活配置混合型基金（股票上限 80%）中排名第 8，华夏沪深 300 指数增强 A 在 39 只增强指数股票型基金中排名第 11；固定收益类产品中，华夏理财 30 天债券在 41 只短期理财债券型基金中排名第 9，华夏薪金宝货币在 194 只货币型基金中排名第 13。

在《中国证券报》主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2015 年度被动投资金牛基金公司”奖。在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中，华夏基金获得“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”奖。

在客户服务方面，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）实现资产证明和对账单自动获取，客户可以自助提交申请并查询办理进度，业务处理更加高效；（2）网上交易平台上线交通银行、招商银行、民生银行、邮政储蓄银行等快捷支付方式和华夏财富系统，并与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财，拓宽客户交易通道，增加交易便利性；（3）开展“130 万人定投的华夏红利”、“客户个性化白皮书”、“你定，我投”、“书写华夏印象，见证一个行业”等活动，为客户提供多样化的关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王怡欢	本基金的基金经理、股票	2011-02-22	-	12 年	北京大学经济学硕士。2004 年 6 月加入华夏基金管理有限公司

	投资部执行总经理				司，曾任行业研究员、行业研究主管、基金经理助理等。
董阳阳	本基金的基金经理、股票投资部总监	2013-03-11	-	8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，国内经济在地产和基建两大板块的强力复苏下触底回升。信贷投放增长超预期，特别是居民中长期贷款绝对值和占比都达到历史峰值，反映出居民部门加杠杆速度较快。以制造业为代表的民间投资一路向下，挤出效应明显。CPI 总体保持在可控区间，为货币政策的操作赢得了一定空间。上游和中游企业的盈利在低基数甚至亏损的基础上得到边际改善，但回升的力度有限，煤炭、有色金属、螺纹钢等大宗商品价格强势反弹。

A 股上证综指在上半年下跌 17%，传媒、计算机等高估值板块表现落后，食品饮料、有色金属和家电等板块则表现较好。整体而言，A 股上半年对确定性增长的认可度提升，对处于长期底部的大宗商品价格弹性十分敏感。

报告期内，本基金保持了低估值价值类和成长性与估值匹配的 GARP 类个股的核心仓位，小比例参与了主题行情和周期品涨价行情，取得了一定效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.249 元，本报告期份额净值增长率为-13.44%，同期业绩比较基准增长率为-8.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为，如果政策继续维持较为宽松的格局，则经济回升的态势可以维持，但在通胀预期和房价上涨的制约下，下半年政策有转为中性的概率。从市场的角度来看，预计低估值价值股的估值仍有一定提升空间。我们倾向于保持基础持仓结构，同时也将更积极地把握具有价格弹性的板块、中小盘优质成长股和阶段性主题投资机会。

风险层面，美联储年内仍可能加息一次，首先，贫富差距过大的问题已经导致社会不稳定因素持续发酵，其次，英国脱欧、法国恐怖袭击等事件在一定程度上也为全球的决策者敲响了警钟，如一味追求货币宽松，带来的可能仅仅是名义资产价格的泡沫，而非需求的改善。美国加息预期的重启将带来处于高位的资产价格的大幅波动。中长期来看，市场风险偏好回升还需要坚定持续地推进改革，这也将是我们持续跟踪和研究的重点。

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

2016 年上半年度，基金托管人在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2016 年上半年度，华夏基金管理有限公司在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2016年上半年度，由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	-	-
结算备付金		770,788,688.91	655,644,151.96
存出保证金		1,503,032.06	2,745,388.32
交易性金融资产	6.4.7.2	3,483,592,628.29	4,410,099,206.50
其中：股票投资		3,401,878,882.09	4,178,096,133.70
基金投资		-	-
债券投资		81,713,746.20	232,003,072.80
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	-	-
应收证券清算款		79,605,527.91	-
应收利息	6.4.7.5	2,313,879.72	3,838,950.39
应收股利		-	-
应收申购款		127,528.09	544,870.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,337,931,284.98	5,072,872,567.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,008.00	15,341,510.41
应付赎回款		6,287,630.79	6,287,905.75
应付管理人报酬		5,207,112.16	6,395,231.71
应付托管费		867,852.04	1,065,871.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	26,297,460.72	41,712,074.89
应交税费		166,385.89	166,385.89
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,368,892.98	1,515,014.39
负债合计		40,200,342.58	72,483,994.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,474,600,640.93	1,485,641,904.59
未分配利润	6.4.7.10	2,823,130,301.47	3,514,746,668.37
所有者权益合计		4,297,730,942.40	5,000,388,572.96
负债和所有者权益总计		4,337,931,284.98	5,072,872,567.92

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.249元，基金份额总额3,439,722,685.68份。

6.2 利润表

会计主体：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-614,000,456.20	3,095,825,742.65
1.利息收入		7,327,913.98	13,318,236.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,705,153.37	2,760,534.41
债券利息收入		2,568,748.69	10,055,349.48

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		54,011.92	502,352.31
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-329,818,910.08	3,038,048,302.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-346,591,749.56	2,956,527,811.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	45,396.46	28,196,500.23
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	16,727,443.02	53,323,991.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-291,748,857.12	36,652,040.68
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	239,397.02	7,807,163.21
减：二、费用		54,730,802.79	96,301,847.25
1.管理人报酬		31,515,427.09	60,423,342.30
2.托管费		5,252,571.19	10,070,557.02
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	17,740,169.23	25,442,886.07
5.利息支出		5,566.68	124,918.69
其中：卖出回购金融资产支出		5,566.68	124,918.69
6.其他费用	6.4.7.21	217,068.60	240,143.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-668,731,258.99	2,999,523,895.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-668,731,258.99	2,999,523,895.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	1,485,641,904.59	3,514,746,668.37	5,000,388,572.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-668,731,258.99	-668,731,258.99

润)			
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）	-11,041,263.66	-22,885,107.91	-33,926,371.57
其中：1.基金申购款	55,785,650.26	101,804,970.05	157,590,620.31
2.基金赎回款	-66,826,913.92	-124,690,077.96	-191,516,991.88
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）	1,474,600,640.93	2,823,130,301.47	4,297,730,942.40
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	3,141,571,987.30	4,975,563,612.28	8,117,135,599.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,999,523,895.40	2,999,523,895.40
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）	-1,443,482,876.68	-3,556,450,088.69	-4,999,932,965.37
其中：1.基金申购款	363,102,098.74	882,688,600.76	1,245,790,699.50
2.基金赎回款	-1,806,584,975.42	-4,439,138,689.45	-6,245,723,664.87
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）	1,698,089,110.62	4,418,637,418.99	6,116,726,529.61

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

根据原兴科证券投资基金（以下简称“原基金兴科”）基金份额持有人大会

审议通过的《关于兴科证券投资基金转型有关事项的议案》，并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[2007]107号《关于核准兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由原兴科证券投资基金转型而来。根据中国证监会批复及深圳证券交易所深证复[2007]24号《关于同意兴科证券投资基金终止上市并转型为上市开放式基金的批复》的同意，原基金兴科于2007年4月23日进行终止上市权利登记，2007年4月24日起终止上市。原《兴科证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》于同一日起生效，同时原基金兴科更名为华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）。原基金兴科于基金合同失效前一日经审计的基金资产净值为1,397,999,526.25元，于本基金基金合同生效日转入本基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定2007年5月10日为基金份额折算基准日。折算前基金资产净值为1,165,930,905.62元，基金份额总额为500,000,000份。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为1:2.331861811，折算后基金份额净值为1.000元，基金份额总额为1,165,930,905份。

本基金在基金合同生效后于2007年4月27日开放集中申购，共募集9,964,660,076.62元，其中用于折合基金份额的集中申购资金利息共计902,304.53元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（07）第B003号审计报告予以验证。上述集中申购募集资金已按2007年5月10日基金份额折算后的基金份额净值1.000元折合为9,964,660,076.62份基金份额，其中集中申购资金利息折合902,304.53份基金份额，并于2007年5月11日进行了确认登记。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2007]第79号文审核同意，本基金1,165,930,905份基金份额于2007年5月28日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏蓝筹核心混合型证券投资

基金（LOF）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，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证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。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》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、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3、存款利息收入不征收增值税。

4、国债、地方政府债及政策性金融债券利息收入、质押式买入返售金融商品利息收入、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税。

5、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、利息收入时代扣代缴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，自2015年9月8日起暂免征收个人所得税。

6、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。

7、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

本基金本报告期末无银行存款余额。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,251,141,958.13	3,401,878,882.09	150,736,923.96

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	31,420,988.83	31,713,746.20	292,757.37
	银行间市场	49,992,700.00	50,000,000.00	7,300.00
	合计	81,413,688.83	81,713,746.20	300,057.37
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,332,555,646.96	3,483,592,628.29	151,036,981.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	6,000.33
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	314,404.02
应收债券利息	1,992,799.07
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	676.30
合计	2,313,879.72

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	26,297,070.72
银行间市场应付交易费用	390.00
合计	26,297,460.72

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00
应付赎回费	23,696.76
预提费用	203,880.04
其他	141,316.18
合计	1,368,892.98

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,465,476,879.87	1,485,641,904.59
本期申购	130,126,624.70	55,785,650.26
本期赎回（以“-”号填列）	-155,880,818.89	-66,826,913.92
本期末	3,439,722,685.68	1,474,600,640.93

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	4,200,136,689.30	-685,390,020.93	3,514,746,668.37
本期利润	-376,982,401.87	-291,748,857.12	-668,731,258.99
本期基金份额交易产生的变动数	-27,472,588.12	4,587,480.21	-22,885,107.91
其中：基金申购款	148,821,778.77	-47,016,808.72	101,804,970.05
基金赎回款	-176,294,366.89	51,604,288.93	-124,690,077.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,795,681,699.31	-972,551,397.84	2,823,130,301.47

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	86,979.81
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	4,600,765.95
其他	17,407.61
合计	4,705,153.37

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	6,002,939,229.87
减：卖出股票成本总额	6,349,530,979.43
买卖股票差价收入	-346,591,749.56

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	152,565,803.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	149,757,403.54
减：应收利息总额	2,763,003.13
买卖债券差价收入	45,396.46

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.3 贵金属投资——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.4 贵金属投资——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本报告期无其他衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,727,443.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,727,443.02

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-291,748,857.12
——股票投资	-291,216,934.06
——债券投资	-531,923.06
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-291,748,857.12

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	239,397.02
合计	239,397.02

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	17,740,169.23
银行间市场交易费用	-
合计	17,740,169.23

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	54,700.10
信息披露费	119,344.68
上市费	29,835.26
银行间账户维护费	9,000.00
银行费用	4,188.56
合计	217,068.60

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、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	31,515,427.09	60,423,342.30
其中：支付销售机构的客户维护费	6,406,050.06	12,411,967.76

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 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,252,571.19	10,070,557.02

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至 2016年6月30日	2015年1月1日至 2015年6月30日
期初持有的基金份额	57,727,975.27	50,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	57,727,975.27	50,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.68%	1.26%

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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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	
	2016年1月1日至 2016年6月30日		2015年1月1日至 2015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
交通银行活期存款	-	86,979.81	-	99,415.81

注：①本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

②除此之外，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2016年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2015年6月30日：同）。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

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（2016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
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新发流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新发流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新发流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新发流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002175	东方网络	2016-05-09	重大事项	54.54	-	-	921,400	45,231,074.56	50,253,156.00	-
000401	冀东水泥	2016-04-06	重大事项	10.60	2016-07-14	11.32	2,745,200	28,903,448.00	29,099,120.00	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项	19.22	-	-	1,000,000	20,701,360.16	19,220,000.00	-
300362	天翔环境	2016-01-11	重大事项	57.40	2016-07-28	17.60	300,000	15,239,321.88	17,220,000.00	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大事项	56.68	-	-	282,860	12,351,492.63	16,032,504.80	-
600576	万家文化	2016-04-11	重大事项	22.35	-	-	654,900	14,171,462.70	14,637,015.00	-
600896	中海海盛	2016-05-23	重大事项	10.54	-	-	999,910	18,123,097.59	10,539,051.40	-
002576	通达动力	2016-06-14	重大事	18.83	-	-	513,500	11,304,800.45	9,669,205.00	-

			项							
002127	南极电商	2016-05-16	重大事项	9.63	-	-	1,000,000	10,175,047.00	9,630,000.00	-
603398	邦宝益智	2016-06-28	重大事项	36.94	2016-07-08	39.00	218,400	8,442,727.39	8,067,696.00	-
000802	北京文化	2016-06-01	重大事项	23.52	2016-08-22	21.86	250,000	6,932,378.00	5,880,000.00	-
002319	乐通股份	2016-06-02	重大事项	17.28	-	-	267,600	4,491,314.11	4,624,128.00	-
000524	岭南控股	2016-04-05	重大事项	13.08	-	-	300,910	3,506,696.20	3,935,902.80	-
300061	康耐特	2016-05-05	重大事项	28.84	2016-07-21	31.56	112,700	2,473,602.24	3,250,268.00	-
000004	国农科技	2016-03-24	重大事项	36.83	-	-	82,500	2,632,716.46	3,038,475.00	-
600738	兰州民百	2016-03-23	重大事项	8.49	2016-07-11	9.34	339,100	2,737,321.87	2,878,959.00	-
600113	浙江东日	2016-03-25	重大事项	12.05	2016-07-25	13.24	233,800	2,702,041.00	2,817,290.00	-
300332	天壕环境	2016-04-11	重大事项	9.37	2016-07-29	9.91	100,000	605,268.98	937,000.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项	20.92	2016-07-01	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-
000710	天兴仪表	2016-06-15	重大事项	22.12	-	-	13,000	334,798.53	287,560.00	-
002101	广东鸿图	2016-05-03	重大事项	21.62	-	-	11,050	245,208.00	238,901.00	-
000803	金宇车城	2016-06-23	重大事项	21.24	-	-	10,000	208,200.82	212,400.00	-
603919	金徽酒	2016-06-06	重大事项	30.90	2016-07-05	33.99	264	2,888.16	8,157.60	-

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

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理

人通过监测组合久期、Beta 值等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 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	770,788,688.91	-	-	770,788,688.91
结算保证金	1,503,032.06	-	-	1,503,032.06
债券投资	59,604,622.10	22,109,124.10	-	81,713,746.20
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	8,291.63	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	655,644,151.96	-	-	655,644,151.96
结算保证金	2,745,388.32	-	-	2,745,388.32
债券投资	203,595,452.70	28,407,620.10	-	232,003,072.80
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	114,498.24	-	-	114,498.24
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2016 年 6 月 30 日）	上年度末 （2015 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	132,985.65	328,161.10
利率上升 25 个基点	-131,971.17	-328,059.60	

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	3,401,878,882.09	79.16	4,178,096,133.70	83.56
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	3,401,878,882.09	79.16	4,178,096,133.70	83.56

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	上年度末

		(2016年6月30日)	(2015年12月31日)
	+5%	205,490,493.87	209,740,425.91
	-5%	-205,490,493.87	-209,740,425.91

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2016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3,322,526,606.09元，第二层次的余额为161,066,022.20元，第三层次的余额为0元。（截至2015年12月31日止：第一层次的余额为4,032,929,035.57元，第二层次的余额为377,170,170.93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、收盘价异常的债券，本基金将相关股票和债券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、债券收盘价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。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），本基金于2015年3月20日起改为采用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，并

将其公允价值从第一层次调整至第二层次。

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	3,401,878,882.09	78.42
	其中：股票	3,401,878,882.09	78.42
2	固定收益投资	81,713,746.20	1.88
	其中：债券	81,713,746.20	1.88
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	770,788,688.91	17.77
7	其他各项资产	83,549,967.78	1.93
8	合计	4,337,931,284.98	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	25,418,972.24	0.59
B	采矿业	85,777,807.88	2.00
C	制造业	1,836,489,680.85	42.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	83,578,613.21	1.94
E	建筑业	196,649,735.24	4.58
F	批发和零售业	109,726,160.34	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	167,936,320.64	3.91
H	住宿和餐饮业	3,935,902.80	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	145,130,148.09	3.38
J	金融业	420,434,409.73	9.78

K	房地产业	177,642,674.11	4.13
L	租赁和商务服务业	53,599,951.04	1.25
M	科学研究和技术服务业	10,499,307.85	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	12,220,000.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,761,035.84	0.55
R	文化、体育和娱乐业	49,078,162.23	1.14
S	综合	-	-
	合计	3,401,878,882.09	79.16

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	600036	招商银行	14,000,000	245,000,000.00	5.70
2	600612	老凤祥	5,780,325	236,126,276.25	5.49
3	002051	中工国际	6,239,088	122,722,860.96	2.86
4	000423	东阿阿胶	1,749,966	92,450,703.78	2.15
5	601021	春秋航空	1,562,781	74,919,721.14	1.74
6	600900	长江电力	5,400,000	67,446,000.00	1.57
7	601166	兴业银行	3,529,700	53,792,628.00	1.25
8	002175	东方网络	921,400	50,253,156.00	1.17
9	002081	金螳螂	5,000,000	50,100,000.00	1.17
10	000876	新希望	5,999,914	49,919,284.48	1.16
11	000581	威孚高科	2,458,550	49,564,368.00	1.15
12	600004	白云机场	3,995,729	48,987,637.54	1.14
13	600804	鹏博士	2,538,874	46,283,673.02	1.08
14	600056	中国医药	2,824,634	44,798,695.24	1.04
15	601607	上海医药	2,418,800	43,659,340.00	1.02
16	600521	华海药业	1,766,516	42,961,669.12	1.00
17	600298	安琪酵母	2,296,600	40,971,344.00	0.95
18	600398	海澜之家	3,556,005	40,182,856.50	0.93
19	601688	华泰证券	1,999,999	37,839,981.08	0.88
20	300230	永利股份	1,262,719	36,719,868.52	0.85
21	600138	中青旅	1,844,822	35,641,961.04	0.83
22	300017	网宿科技	499,984	33,598,924.80	0.78
23	600622	嘉宝集团	2,400,260	33,003,575.00	0.77

24	601318	中国平安	1,000,000	32,040,000.00	0.75
25	000902	新洋丰	2,553,672	31,946,436.72	0.74
26	002450	康得新	1,847,852	31,598,269.20	0.74
27	002311	海大集团	1,981,796	31,252,922.92	0.73
28	300156	神雾环保	1,500,000	30,870,000.00	0.72
29	600683	京投发展	3,199,298	29,561,513.52	0.69
30	000401	冀东水泥	2,745,200	29,099,120.00	0.68
31	601009	南京银行	3,059,899	28,732,451.61	0.67
32	000055	方大集团	1,500,000	28,230,000.00	0.66
33	002026	山东威达	2,211,889	27,803,444.73	0.65
34	300078	思创医惠	800,000	26,752,000.00	0.62
35	002508	老板电器	674,847	24,814,124.19	0.58
36	002494	华斯股份	1,599,907	24,718,563.15	0.58
37	600519	贵州茅台	79,907	23,326,451.44	0.54
38	600477	杭萧钢构	3,380,000	23,051,600.00	0.54
39	300336	新文化	900,000	22,482,000.00	0.52
40	002271	东方雨虹	1,299,902	22,397,311.46	0.52
41	600711	盛屯矿业	3,000,000	22,200,000.00	0.52
42	600887	伊利股份	1,300,000	21,671,000.00	0.50
43	601992	金隅股份	2,795,654	21,666,318.50	0.50
44	002385	大北农	2,659,300	21,433,958.00	0.50
45	002092	中泰化学	2,527,164	21,379,807.44	0.50
46	002366	台海核电	399,936	21,320,588.16	0.50
47	300072	三聚环保	766,746	21,192,859.44	0.49
48	600029	南方航空	2,999,976	21,179,830.56	0.49
49	600885	宏发股份	674,579	20,716,321.09	0.48
50	600197	伊力特	1,290,750	19,412,880.00	0.45
51	000651	格力电器	1,000,000	19,220,000.00	0.45
52	002454	松芝股份	1,050,000	19,089,000.00	0.44
53	600137	浪莎股份	649,100	19,012,139.00	0.44
54	603799	华友钴业	509,512	18,953,846.40	0.44
55	600585	海螺水泥	1,300,000	18,902,000.00	0.44
56	000820	金城股份	1,049,904	18,898,272.00	0.44
57	002045	国光电器	1,272,843	18,176,198.04	0.42
58	600061	国投安信	1,001,100	17,839,602.00	0.42
59	600639	浦东金桥	700,000	17,486,000.00	0.41
60	000402	金融街	1,794,301	17,440,605.72	0.41

61	300362	天翔环境	300,000	17,220,000.00	0.40
62	600376	首开股份	1,542,945	17,157,548.40	0.40
63	300204	舒泰神	900,000	16,596,000.00	0.39
64	600259	广晟有色	288,100	16,496,606.00	0.38
65	000983	西山煤电	2,000,000	16,300,000.00	0.38
66	600371	万向德农	1,001,175	16,219,035.00	0.38
67	002378	章源钨业	1,548,892	16,185,921.40	0.38
68	002367	康力电梯	1,041,152	16,033,740.80	0.37
69	300038	梅泰诺	282,860	16,032,504.80	0.37
70	002444	巨星科技	786,700	15,985,744.00	0.37
71	000526	银润投资	319,797	15,797,971.80	0.37
72	600266	北京城建	1,249,941	15,611,763.09	0.36
73	002077	大港股份	700,000	15,540,000.00	0.36
74	002517	恺英网络	352,100	15,520,568.00	0.36
75	000656	金科股份	3,968,866	15,161,068.12	0.35
76	300015	爱尔眼科	412,128	15,055,035.84	0.35
77	600536	中国软件	600,000	14,952,000.00	0.35
78	002038	双鹭药业	494,500	14,924,010.00	0.35
79	002456	欧菲光	500,000	14,750,000.00	0.34
80	600576	万家文化	654,900	14,637,015.00	0.34
81	002155	湖南黄金	1,104,764	14,549,741.88	0.34
82	600123	兰花科创	2,000,000	14,360,000.00	0.33
83	000807	云铝股份	2,000,000	13,100,000.00	0.30
84	000630	铜陵有色	5,013,000	12,733,020.00	0.30
85	002172	澳洋科技	1,182,678	12,690,134.94	0.30
86	600373	中文传媒	611,171	12,681,798.25	0.30
87	603898	好莱客	396,000	12,311,640.00	0.29
88	000963	华东医药	182,283	12,285,874.20	0.29
89	000826	启迪桑德	400,000	12,220,000.00	0.28
90	002792	通宇通讯	204,184	12,210,203.20	0.28
91	002286	保龄宝	805,798	12,070,854.04	0.28
92	000488	晨鸣纸业	1,500,000	11,910,000.00	0.28
93	300271	华宇软件	600,000	11,352,000.00	0.26
94	300224	正海磁材	500,000	11,335,000.00	0.26
95	600605	汇通能源	574,198	11,076,279.42	0.26
96	600587	新华医疗	468,181	10,810,299.29	0.25
97	600896	中海海盛	999,910	10,539,051.40	0.25

98	603959	百利科技	252,815	10,479,181.75	0.24
99	603158	腾龙股份	439,864	10,477,560.48	0.24
100	300233	金城医药	400,000	10,356,000.00	0.24
101	300335	迪森股份	613,230	10,185,750.30	0.24
102	300199	翰宇药业	500,000	10,175,000.00	0.24
103	002032	苏泊尔	295,200	10,169,640.00	0.24
104	002426	胜利精密	1,000,000	9,850,000.00	0.23
105	002576	通达动力	513,500	9,669,205.00	0.22
106	002470	金正大	1,200,000	9,660,000.00	0.22
107	002127	南极电商	1,000,000	9,630,000.00	0.22
108	600386	北巴传媒	500,000	9,330,000.00	0.22
109	002299	圣农发展	349,967	9,064,145.30	0.21
110	600826	兰生股份	344,917	9,029,927.06	0.21
111	600559	老白干酒	375,750	9,002,970.00	0.21
112	300347	泰格医药	300,000	8,706,000.00	0.20
113	002598	山东章鼓	726,200	8,641,780.00	0.20
114	300484	蓝海华腾	74,000	8,635,800.00	0.20
115	300418	昆仑万维	302,081	8,539,829.87	0.20
116	600476	湘邮科技	300,000	8,457,000.00	0.20
117	002662	京威股份	555,500	8,393,605.00	0.20
118	002205	国统股份	342,100	8,155,664.00	0.19
119	002655	共达电声	500,000	8,075,000.00	0.19
120	603398	邦宝益智	218,400	8,067,696.00	0.19
121	603019	中科曙光	200,000	7,964,000.00	0.19
122	002533	金杯电工	590,100	7,925,043.00	0.18
123	002295	精艺股份	500,000	7,850,000.00	0.18
124	000666	经纬纺机	400,000	7,800,000.00	0.18
125	000530	大冷股份	720,450	7,679,997.00	0.18
126	000793	华闻传媒	749,998	7,409,980.24	0.17
127	300267	尔康制药	506,000	7,245,920.00	0.17
128	002324	普利特	245,296	7,143,019.52	0.17
129	000513	丽珠集团	154,300	7,114,773.00	0.17
130	002597	金禾实业	517,700	6,973,419.00	0.16
131	300136	信维通信	325,787	6,828,495.52	0.16
132	002667	鞍重股份	216,300	6,594,987.00	0.15
133	600009	上海机场	250,000	6,512,500.00	0.15
134	601012	隆基股份	497,900	6,497,595.00	0.15

135	600355	精伦电子	857,400	6,456,222.00	0.15
136	603528	多伦科技	61,500	6,026,385.00	0.14
137	000802	北京文化	250,000	5,880,000.00	0.14
138	000828	东莞控股	638,500	5,797,580.00	0.13
139	002048	宁波华翔	250,000	5,717,500.00	0.13
140	600850	华东电脑	195,000	5,594,550.00	0.13
141	002400	省广股份	390,000	5,510,700.00	0.13
142	600452	涪陵电力	149,951	5,009,862.91	0.12
143	002319	乐通股份	267,600	4,624,128.00	0.11
144	000563	陕国投 A	841,200	4,618,188.00	0.11
145	603766	隆鑫通用	219,300	4,434,246.00	0.10
146	603108	润达医疗	150,000	4,228,500.00	0.10
147	000524	岭南控股	300,910	3,935,902.80	0.09
148	300510	金冠电气	52,592	3,553,115.52	0.08
149	600201	生物股份	123,000	3,361,590.00	0.08
150	300061	康耐特	112,700	3,250,268.00	0.08
151	000004	国农科技	82,500	3,038,475.00	0.07
152	600738	兰州民百	339,100	2,878,959.00	0.07
153	600855	航天长峰	90,900	2,845,170.00	0.07
154	300424	航新科技	41,910	2,838,145.20	0.07
155	000021	深科技	257,600	2,836,176.00	0.07
156	600113	浙江东日	233,800	2,817,290.00	0.07
157	600343	航天动力	116,700	2,775,126.00	0.06
158	000418	小天鹅 A	81,541	2,659,867.42	0.06
159	600337	美克家居	191,700	2,494,017.00	0.06
160	600489	中金黄金	166,500	1,871,460.00	0.04
161	002094	青岛金王	44,900	1,199,279.00	0.03
162	002007	华兰生物	32,000	1,004,800.00	0.02
163	300332	天壕环境	100,000	937,000.00	0.02
164	300285	国瓷材料	21,000	837,690.00	0.02
165	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.02
166	300096	易联众	41,500	761,110.00	0.02
167	300228	富瑞特装	44,483	756,211.00	0.02
168	002208	合肥城建	34,321	666,513.82	0.02
169	600809	山西汾酒	26,700	592,206.00	0.01
170	002797	第一创业	14,144	571,559.04	0.01
171	002098	浔兴股份	47,731	554,634.22	0.01

172	002136	安纳达	33,219	522,202.68	0.01
173	002680	长生生物	10,000	415,400.00	0.01
174	300207	欣旺达	15,971	409,975.57	0.01
175	002343	慈文传媒	8,000	388,000.00	0.01
176	002335	科华恒盛	7,400	359,048.00	0.01
177	000779	三毛派神	15,422	346,223.90	0.01
178	600079	人福医药	20,000	335,400.00	0.01
179	002250	联化科技	20,700	296,424.00	0.01
180	000710	天兴仪表	13,000	287,560.00	0.01
181	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
182	002101	广东鸿图	11,050	238,901.00	0.01
183	300133	华策影视	15,182	236,383.74	0.01
184	002690	美亚光电	10,000	230,400.00	0.01
185	002016	世荣兆业	26,164	216,114.64	0.01
186	000803	金宇车城	10,000	212,400.00	0.00
187	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
188	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
189	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.00
190	603339	四方冷链	2,793	151,995.06	0.00
191	600303	曙光股份	10,000	148,500.00	0.00
192	300511	雪榕生物	2,038	135,791.94	0.00
193	603101	汇嘉时代	3,563	106,248.66	0.00
194	603779	威龙股份	1,990	83,500.40	0.00
195	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
196	002795	永和智控	1,030	70,122.40	0.00
197	002793	东音股份	1,003	65,205.03	0.00
198	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
199	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
200	002292	奥飞娱乐	1,926	57,683.70	0.00
201	603029	天鹅股份	1,148	51,235.24	0.00
202	603726	朗迪集团	966	48,831.30	0.00
203	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
204	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
205	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
206	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
207	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
208	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00

209	002791	坚朗五金	166	8,925.82	0.00
210	603919	金徽酒	264	8,157.60	0.00
211	300490	华自科技	200	5,800.00	0.00
212	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
213	603299	井神股份	300	5,151.00	0.00
214	300505	川金诺	76	4,594.96	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	002092	中泰化学	110,376,159.64	2.21
2	600804	鹏博士	110,213,174.54	2.20
3	002051	中工国际	108,926,092.33	2.18
4	601021	春秋航空	106,847,810.29	2.14
5	002081	金螳螂	82,498,110.90	1.65
6	600521	华海药业	72,537,166.13	1.45
7	000898	鞍钢股份	71,491,274.07	1.43
8	300133	华策影视	57,323,937.29	1.15
9	000858	五粮液	57,305,761.12	1.15
10	000630	铜陵有色	56,930,803.52	1.14
11	300336	新文化	56,691,336.33	1.13
12	600056	中国医药	55,824,069.90	1.12
13	000581	威孚高科	54,541,173.02	1.09
14	000709	河钢股份	54,463,050.27	1.09
15	000876	新希望	52,339,213.20	1.05
16	600519	贵州茅台	51,178,035.64	1.02
17	000401	冀东水泥	49,698,033.52	0.99
18	601688	华泰证券	48,804,506.13	0.98
19	002007	华兰生物	48,246,845.35	0.96
20	600622	嘉宝集团	47,223,291.51	0.94

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	600036	招商银行	99,929,842.03	2.00
2	002092	中泰化学	95,236,929.45	1.90
3	600612	老凤祥	82,452,368.63	1.65
4	601318	中国平安	70,821,810.26	1.42
5	600728	佳都科技	70,579,774.74	1.41
6	600004	白云机场	68,547,846.85	1.37
7	300133	华策影视	61,142,417.77	1.22
8	601166	兴业银行	60,863,921.66	1.22
9	600271	航天信息	59,972,266.08	1.20
10	000858	五粮液	59,835,786.27	1.20
11	000898	鞍钢股份	58,778,632.86	1.18
12	600804	鹏博士	56,803,504.21	1.14
13	002007	华兰生物	54,766,891.71	1.10
14	000709	河钢股份	46,810,602.29	0.94
15	600781	辅仁药业	45,869,378.60	0.92
16	002668	奥马电器	44,790,463.30	0.90
17	000797	中国武夷	44,680,063.04	0.89
18	002739	万达院线	44,507,547.39	0.89
19	600521	华海药业	42,511,125.44	0.85
20	000563	陕国投 A	42,438,547.44	0.85

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,864,530,661.88
卖出股票收入（成交）总额	6,002,939,229.87

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	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,000,000.00	1.16
	其中：政策性金融债	50,000,000.00	1.16
4	企业债券	31,713,746.20	0.74
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	81,713,746.20	1.90

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	150416	15 农发 16	500,000	50,000,000.00	1.16
2	112044	11 中泰 01	50,000	5,276,500.00	0.12
3	122641	PR 武城投	80,000	4,103,200.00	0.10
4	122911	10 鞍城投	34,860	3,668,666.40	0.09
5	122086	11 正泰债	34,870	3,491,184.40	0.08

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 2015年11月30日东方网络收到了深圳证券交易所《关于对东方时代网络传媒股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》。本基金投资该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,503,032.06
2	应收证券清算款	79,605,527.91
3	应收股利	-
4	应收利息	2,313,879.72
5	应收申购款	127,528.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,549,967.78

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002175	东方网络	50,253,156.00	1.17	重大事项

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
243,540	14,123.85	70,298,232.53	2.04%	3,369,424,453.15	97.96%

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	华夏基金管理有限公司	50,000,000	28.12%
2	陕西信托解放路证券营业部	3,450,531	1.94%
3	刘秀云	1,397,554	0.79%
4	邓治良	871,306	0.49%
5	陶秀英	678,100	0.38%
6	南通汽运实业集团有限公司	626,930	0.35%
7	徐显良	513,010	0.29%
8	郭福珍	500,000	0.28%
9	李彩雁	484,249	0.27%
10	张凯裕	475,917	0.27%

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	181,729.86	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	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年4月24日）基金份额总额	500,000,000.00
---------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	3,465,476,879.87
本报告期基金总申购份额	130,126,624.70
减：本报告期基金总赎回份额	155,880,818.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,439,722,685.68

§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

根据本基金管理人发布的相关公告，孙毅先生自2016年1月1日起任华夏基金管理有限公司副总经理，自2016年6月30日起不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

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	
光大证券	1	2,320,810,193.32	19.57%	2,161,374.92	20.23%	-
中金公司	1	1,769,652,394.13	14.92%	1,648,076.55	15.42%	-
国信证券	1	1,748,702,736.31	14.74%	1,628,569.68	15.24%	-

广发证券	1	1,471,834,993.08	12.41%	1,076,354.77	10.07%	-
申万宏源证券	1	1,288,110,241.69	10.86%	1,199,618.10	11.23%	-
中泰证券	1	1,030,806,662.94	8.69%	959,991.38	8.98%	-
中信建投证券	3	909,951,687.52	7.67%	847,436.12	7.93%	-
中国银河证券	1	713,957,397.26	6.02%	664,911.16	6.22%	-
浙商证券	1	330,088,546.05	2.78%	241,392.89	2.26%	-
东方证券	1	276,357,128.80	2.33%	257,371.47	2.41%	-

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，本基金还选择了东吴证券、国泰君安证券、国元证券、西藏东方财富证券、华泰证券、东兴证券、西部证券、招商证券、华宝证券、长城证券、民族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，浙商证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例

中金公司	4,464,372.00	81.84%	95,000,000.00	100.00%
中泰证券	990,628.00	18.16%	-	-

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指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
3	华夏基金管理有限公司关于指数熔断期间旗下基金场内申赎业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-05
4	华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-07
5	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-13
6	华夏基金管理有限公司关于调整中国建设银行储蓄卡基金电子交易优惠费率的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-21
7	华夏基金管理有限公司关于设立上海华夏财富投资管理有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-30
8	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增联讯证券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	2016-02-18
9	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增江苏江南农村商业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	2016-03-03
10	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-04
11	关于华夏基金管理有限公司旗下部分开放式基金在大同证券有限责任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	2016-03-08
12	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-15
13	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海华夏财富投资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	2016-04-22
14	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开	中国证监会指	2016-05-10

	放式基金新增深圳众禄金融控股股份有限公司为代销机构的公告	定报刊及网站	
15	关于停止支付宝基金专户电子交易开户及认购、申购、定期定额申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-13
16	关于华夏回报证券投资基金等基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-25

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

11.1.1 中国证监会核准基金兴科转型的文件；

11.1.2 《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

11.1.3 《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

11.1.4 法律意见书；

11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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

二〇一六年八月二十七日