

华夏成长证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	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.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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情况.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	43
§11 备查文件目录.....	47

§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	000002
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	4,603,270,168.04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	张静	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	王洪章

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	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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-759,398,924.68
本期利润	-1,180,194,078.43
加权平均基金份额本期利润	-0.2595
本期加权平均净值利润率	-23.38%
本期基金份额净值增长率	-19.39%
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	524,110,635.42
期末可供分配基金份额利润	0.1139
期末基金资产净值	5,127,380,803.46
期末基金份额净值	1.114
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	477.00%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.01%	0.85%	-	-	-	-

过去三个月	-0.98%	1.01%	-	-	-	-
过去六个月	-19.39%	1.65%	-	-	-	-
过去一年	-30.15%	1.82%	-	-	-	-
过去三年	28.50%	1.44%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	477.00%	1.30%	-	-	-	-

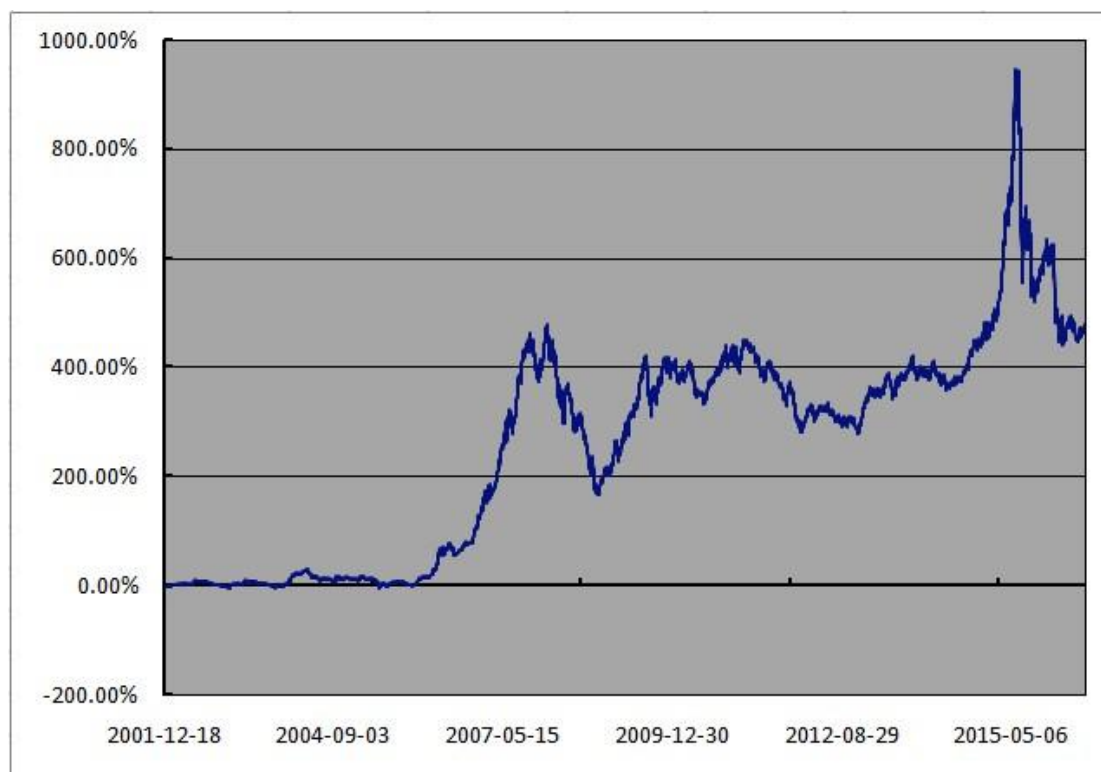
注：本基金未规定业绩比较基准。

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 2016 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，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		
李铨汶	本基金的基金经理、股票投资部总监	2014-03-17	-	9 年	清华大学管理学硕士。曾任易方达基金研究员等。2010 年 3 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

					经理助理等。
董阳阳	本基金的基金经理、股票投资部总监	2015-01-07	-	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。
许利明	本基金的基金经理、股票投资部总监	2015-09-01	-	18 年	北京工商大学产业经济学硕士。曾任北京国际信托投资公司投资银行总部项目经理，湘财证券有限责任公司资产管理总部总经理助理等，北京鹿苑天闻投资顾问有限责任公司首席投资顾问，天弘基金管理有限公司投资部副总经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理(2007 年 7 月 27 日至 2009 年 3 月 30 日期间)等，中国国际金融有限公司投资经理。2011 年 6 月加入华夏基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理等。
孙萌	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2015-11-19	-	9 年	北京邮电大学工学硕士。曾任长盛基金管理有限公司研究员。2009 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理等。

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，英国脱欧、土耳其军事政变未遂、法国频繁发生恐怖袭击，欧洲金融市场不确定性增加；以美国为代表的成熟市场屡创新高，主要原因在于全球流动性泛滥且有愈演愈烈的趋势。国内方面，地产的强势复苏和基建的拉动作用是上半年 GDP 保持 6.7% 增速底线的主要动力，另外接近 10 万亿的社会融资总量为资本市场提供了宽裕的流动性。

A 股市场方面，上证综指上半年收跌 17%，创业板指数收跌 18%。具体而言，经历了 1 月份的股灾后，市场在 3 月份开始活跃，4 月份后弱势震荡并呈现存量博弈的典型特征，新能源汽车、OLED、半导体、物联网等主题阶段性产生了赚钱效应，消费股、有色等周期股和银行等价值股也有较好表现。

报告期内，本基金大部分时间维持了中性偏低的仓位，主要布局在稳定成长类和价值类个股上，对热点主题的参与度有限。具体行业配置上，主要增加了对

黄金、饲料、食品饮料、生物医药板块的配置，并取得了较好的收益，但由于对传媒、通信等成长类板块中的个股减持不够及时，基金净值受到一定拖累。

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 1.114 元，本报告期份额净值增长率为-19.39%，同期上证综指下跌 17.22%，深证成指下跌 17.17%。

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，我们对未来的经济走势有些许迷茫：我国经济是继续推进供给侧改革？还是延续上半年的强刺激？中国的杠杆率和债务问题如何化解？在这些问题的答案明朗之前，市场恐怕无法出现系统性机会，我们仍执着地期待改革的破冰。市场风格方面，预计将延续存量博弈的格局，风险偏好可能会继续下降，基于此，我们倾向于增加对价值股和稳定成长股的配置。

投资策略方面，一方面，我们将采取“自下而上”的选股原则，提高甄选标准，去伪存真，努力寻找真成长股并长期持有；另一方面，我们将继续关注宏观经济和政策的走向，寻找市场的预期差，关注由此带来的潜在投资机会或风险。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所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的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏成长证券投资基金

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	782,757,481.95	398,719,112.87
结算备付金		11,299,096.99	38,087,267.39
存出保证金		2,353,680.08	4,051,656.03
交易性金融资产	6.4.7.2	4,356,333,711.16	5,629,636,840.16
其中：股票投资		2,939,439,248.66	4,218,386,276.86
基金投资		-	-
债券投资		1,416,894,462.50	1,411,250,563.30
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	298,981,107.15	220,000,230.00
应收证券清算款		139,325,607.83	21,126,045.76
应收利息	6.4.7.5	21,830,822.57	24,849,509.37
应收股利		-	-
应收申购款		921,777.22	3,194,232.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,613,803,284.95	6,339,664,894.32
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		393,000,000.00	-
应付证券清算款		40,582,674.76	163,936,395.17
应付赎回款		13,124,846.09	10,554,237.84
应付管理人报酬		6,213,750.72	7,712,886.26
应付托管费		1,035,625.10	1,285,481.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	28,884,009.04	60,539,487.04
应交税费		2,773,127.11	2,773,127.11
应付利息		89,913.80	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	718,534.87	879,776.43
负债合计		486,422,481.49	247,681,390.88

所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,603,270,168.04	4,407,555,959.08
未分配利润	6.4.7.10	524,110,635.42	1,684,427,544.36
所有者权益合计		5,127,380,803.46	6,091,983,503.44
负债和所有者权益总计		5,613,803,284.95	6,339,664,894.32

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.114 元，基金份额总额 4,603,270,168.04 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏成长证券投资基金

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		-1,106,167,868.25	3,528,331,083.00
1.利息收入		32,918,001.08	51,182,572.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,152,595.58	3,438,350.43
债券利息收入		30,513,466.48	43,713,138.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		251,939.02	4,031,083.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-718,765,919.28	2,587,462,362.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-737,809,245.67	2,556,433,498.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,425,123.44	3,771,673.42
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	15,618,202.95	27,257,189.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-420,795,153.75	882,056,401.77
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	475,203.70	7,629,746.43
减：二、费用		74,026,210.18	116,019,389.04
1.管理人报酬		37,696,422.11	66,515,251.42
2.托管费		6,282,737.01	11,085,875.20

3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	29,115,171.38	25,945,091.07
5.利息支出		723,372.59	12,257,342.16
其中：卖出回购金融资产支出		723,372.59	12,257,342.16
6.其他费用	6.4.7.21	208,507.09	215,829.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,180,194,078.43	3,412,311,693.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,180,194,078.43	3,412,311,693.96

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：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）	4,407,555,959.08	1,684,427,544.36	6,091,983,503.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,180,194,078.43	-1,180,194,078.43
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）	195,714,208.96	19,877,169.49	215,591,378.45
其中：1.基金申购款	534,549,115.65	61,170,565.45	595,719,681.10
2.基金赎回款	-338,834,906.69	-41,293,395.96	-380,128,302.65
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）	4,603,270,168.04	524,110,635.42	5,127,380,803.46
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）	6,559,142,348.23	1,165,208,775.93	7,724,351,124.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,412,311,693.96	3,412,311,693.96

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）	-1,962,074,173.98	-1,308,782,071.25	-3,270,856,245.23
其中：1.基金申购款	1,696,807,437.23	1,135,886,685.90	2,832,694,123.13
2.基金赎回款	-3,658,881,611.21	-2,444,668,757.15	-6,103,550,368.36
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）	4,597,068,174.25	3,268,738,398.64	7,865,806,572.89

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：

<u>杨明辉</u>	<u>汪贵华</u>	<u>汪贵华</u>
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

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。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	782,757,481.95
定期存款	-
其他存款	-
合计	782,757,481.95

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	2,960,842,623.58	2,939,439,248.66	-21,403,374.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	632,644,581.29	28,502,881.21
	银行间市场	753,582,542.14	2,164,457.86
	合计	1,386,227,123.43	30,667,339.07
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,347,069,747.01	4,356,333,711.16	9,263,964.15

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	298,981,107.15	298,981,107.15
合计	298,981,107.15	298,981,107.15

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中： 已出 售或 再质 押总 额
银行间	101355011	13 赣州发展 MTN001	2016-07-01	118.40	1,233,000	145,987,200.00	-
银行间	041654031	16 陕煤化	2016-07-01	98.24	1,000,000	98,240,000.00	-

		CP002					
银行间	011699366	16 陕煤 化 SCP002	2016-07-01	99.04	500,000	49,520,000.00	-

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	132,156.60
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,084.60
应收债券利息	21,676,729.86
应收买入返售证券利息	15,792.31
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,059.20
合计	21,830,822.57

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	28,878,587.89
银行间市场应付交易费用	5,421.15
合计	28,884,009.04

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	500,000.00
应付赎回费	49,464.15
预提费用	169,070.72
合计	718,534.87

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	4,407,555,959.08	4,407,555,959.08
本期申购	534,549,115.65	534,549,115.65
本期赎回（以“-”号填列）	-338,834,906.69	-338,834,906.69
本期末	4,603,270,168.04	4,603,270,168.04

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,170,445,156.64	-486,017,612.28	1,684,427,544.36
本期利润	-759,398,924.68	-420,795,153.75	-1,180,194,078.43
本期基金份额交易产生的变动数	74,961,565.86	-55,084,396.37	19,877,169.49
其中：基金申购款	195,830,335.34	-134,659,769.89	61,170,565.45
基金赎回款	-120,868,769.48	79,575,373.52	-41,293,395.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,486,007,797.82	-961,897,162.40	524,110,635.42

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	1,956,329.06
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	171,546.37	
其他	24,720.15	
合计	2,152,595.58	

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	10,384,531,742.50
减：卖出股票成本总额	11,122,340,988.17	
买卖股票差价收入	-737,809,245.67	

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	997,907,215.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	975,645,953.01
减：应收利息总额	18,836,139.41
买卖债券差价收入	3,425,123.44

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	15,618,202.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,618,202.95

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	-420,795,153.75
——股票投资	-412,003,409.42
——债券投资	-8,791,744.33
——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	-420,795,153.75

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	475,203.70
合计	475,203.70

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	29,106,946.38
银行间市场交易费用	8,225.00
合计	29,115,171.38

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	49,726.04
信息披露费	119,344.68
银行费用	20,636.37
银行间账户维护费	18,000.00

其他	800.00
合计	208,507.09

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	基金发起人、基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东、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

金额单位：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	占当期股票成交总额的比例	2015年1月1日至2015年6月30日	占当期股票成交总额的比例
中信证券	8,052,320,706.45	39.02%	3,440,140,674.51	19.58%

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

金额单位：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	
	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	18,281,696.00	100.00%	-	-

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 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	
	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	1,993,000,000.00	72.13%	500,000,000.00	3.37%

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	6,637,881.03	39.30%	5,448,116.05	18.87%
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	2,460,674.88	17.90%	2,460,674.88	5.12%

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 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	37,696,422.11	66,515,251.42
其中：支付销售机构的客户维护费	4,672,672.79	8,002,382.73

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	6,282,737.01	11,085,875.20

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 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	
	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	782,757,481.95	1,956,329.06	778,439,855.01	2,986,467.36

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

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	-	-	1,660,657	82,492,685.01	90,572,232.78	-
300362	天翔环境	2016-01-11	重大事项	57.40	2016-07-28	17.60	399,948	20,316,486.88	22,957,015.20	-
002313	日海通讯	2016-06-20	重大事项	13.59	2016-07-04	14.95	1,113,468	17,821,190.77	15,132,030.12	-
002266	浙富控股	2016-05-25	重大事	5.35	-	-	2,700,000	16,841,242.00	14,445,000.00	-

			项							
000401	冀东水泥	2016-04-06	重大事项	10.60	2016-07-14	11.32	1,101,100	12,082,295.89	11,671,660.00	-
300166	东方国信	2016-06-08	重大事项	27.47	-	-	400,000	9,537,212.79	10,988,000.00	-
603398	邦宝益智	2016-06-28	重大事项	36.94	2016-07-08	39.00	259,200	10,019,722.99	9,574,848.00	-
002447	壹桥海参	2016-03-09	重大事项	7.19	-	-	1,313,106	13,382,331.79	9,441,232.14	-
000948	南天信息	2016-06-28	重大事项	19.31	2016-07-12	21.00	400,000	8,080,774.00	7,724,000.00	-
600455	博通股份	2016-05-05	重大事项	49.14	-	-	145,400	6,672,834.57	7,144,956.00	-
300035	中科电气	2016-05-23	重大事项	13.76	-	-	500,000	6,596,450.28	6,880,000.00	-
000524	岭南控股	2016-04-05	重大事项	13.08	-	-	499,927	5,815,146.26	6,539,045.16	-
600636	三爱富	2016-05-09	重大事项	13.86	-	-	447,800	6,378,807.16	6,206,508.00	-
600385	山东金泰	2016-04-26	重大事项	22.84	2016-08-05	20.56	250,900	6,162,344.69	5,730,556.00	-
300061	康耐特	2016-05-05	重大事项	28.84	2016-07-21	31.56	187,800	4,123,256.78	5,416,152.00	-
000004	国农科技	2016-03-24	重大事项	36.83	-	-	133,200	4,248,138.95	4,905,756.00	-
002212	南洋股份	2016-05-03	重大事项	11.28	2016-08-17	12.41	264,676	2,210,324.11	2,985,545.28	-
002492	恒基达鑫	2016-02-24	重大事项	12.66	-	-	200,000	2,431,849.00	2,532,000.00	-
600121	郑州煤电	2016-06-17	重大事项	4.80	2016-07-01	5.05	500,000	2,518,012.00	2,400,000.00	-
600173	卧龙地产	2016-04-25	重大事项	8.28	-	-	281,700	1,885,081.00	2,332,476.00	-
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	-
002101	广东鸿图	2016-05-03	重大事项	21.62	-	-	26,390	530,544.40	570,551.80	-
000803	金宇车城	2016-06-23	重大事项	21.24	-	-	10,000	209,764.68	212,400.00	-
000920	南方汇通	2016-02-17	重大事项	17.80	2016-07-12	18.10	3,400	56,866.00	60,520.00	-
300508	维宏股份	2016-06-30	重大事项	254.50	2016-07-06	242.00	143	20,047.34	36,393.50	-

300038	梅泰诺	2015-12-16	重大事项	56.68	-	-	442	16,614.64	25,052.56	-
600759	洲际油气	2016-06-27	重大事项	7.58	2016-07-11	8.10	10	87.66	75.80	-

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，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 393,000,000 元，于 2016 年 7 月 4 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，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	782,757,481.95	-	-	782,757,481.95
结算备付金	11,299,096.99	-	-	11,299,096.99
结算保证金	2,353,680.08	-	-	2,353,680.08
债券投资	802,822,536.80	573,967,925.70	40,104,000.00	1,416,894,462.50
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	298,981,107.15	-	-	298,981,107.15
应收直销申购款	34,810.68	-	-	34,810.68
卖出回购金融资产款	393,000,000.00	-	-	393,000,000.00
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计

2015 年 12 月 31 日				
银行存款	398,719,112.87	-	-	398,719,112.87
结算备付金	38,087,267.39	-	-	38,087,267.39
结算保证金	4,051,656.03	-	-	4,051,656.03
债券投资	518,113,527.50	777,615,035.80	115,522,000.00	1,411,250,563.30
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	220,000,230.00	-	-	220,000,230.00
应收直销申购款	26,346.34	-	-	26,346.34
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	4,344,617.29	7,113,099.75
利率上升 25 个基点	-4,298,438.93	-7,089,725.92	

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	2,939,439,248.66	57.33	4,218,386,276.86	69.24
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	2,939,439,248.66	57.33	4,218,386,276.86	69.24

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 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	+5%	202,306,906.29	245,320,253.93
	-5%	-202,306,906.29	-245,320,253.93

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 2,837,195,355.88 元，第二层次的余额为 1,519,138,355.28 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 3,757,067,810.02 元，第二层次的余额为 1,872,569,030.14 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	2,939,439,248.66	52.36
	其中：股票	2,939,439,248.66	52.36
2	固定收益投资	1,416,894,462.50	25.24
	其中：债券	1,416,894,462.50	25.24
	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	298,981,107.15	5.33
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	298,981,107.15	5.33
6	银行存款和结算备付金合计	794,056,578.94	14.14

7	其他各项资产	164,431,887.70	2.93
8	合计	5,613,803,284.95	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	30,572,876.94	0.60
B	采矿业	118,954,815.24	2.32
C	制造业	1,660,601,254.81	32.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	125,891,931.05	2.46
E	建筑业	232,151,592.07	4.53
F	批发和零售业	155,454,196.26	3.03
G	交通运输、仓储和邮政业	38,066,648.64	0.74
H	住宿和餐饮业	6,539,045.16	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	242,525,256.30	4.73
J	金融业	49,716,052.84	0.97
K	房地产业	128,494,436.85	2.51
L	租赁和商务服务业	4,398,000.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	28,244,726.71	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	3,223,200.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	33,186,218.60	0.65
R	文化、体育和娱乐业	74,274,041.19	1.45
S	综合	7,144,956.00	0.14
	合计	2,939,439,248.66	57.33

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	002051	中工国际	8,658,444	170,311,593.48	3.32
2	000876	新希望	12,344,708	102,707,970.56	2.00
3	002175	东方网络	1,660,657	90,572,232.78	1.77
4	600804	鹏博士	4,100,000	74,743,000.00	1.46
5	600887	伊利股份	3,499,950	58,344,166.50	1.14
6	600521	华海药业	2,375,488	57,771,868.16	1.13
7	000963	华东医药	806,706	54,371,984.40	1.06

8	300156	神雾环保	2,400,000	49,392,000.00	0.96
9	002311	海大集团	2,983,921	47,056,434.17	0.92
10	600056	中国医药	2,909,813	46,149,634.18	0.90
11	600519	贵州茅台	149,700	43,700,424.00	0.85
12	300059	东方财富	1,799,908	39,957,957.60	0.78
13	600993	马应龙	1,699,974	35,410,458.42	0.69
14	300145	中金环境	1,617,880	35,399,214.40	0.69
15	600711	盛屯矿业	4,500,000	33,300,000.00	0.65
16	600510	黑牡丹	3,649,048	31,819,698.56	0.62
17	600622	嘉宝集团	2,280,172	31,352,365.00	0.61
18	000820	金城股份	1,642,800	29,570,400.00	0.58
19	002055	得润电子	899,942	27,556,224.04	0.54
20	300015	爱尔眼科	749,820	27,390,924.60	0.53
21	601515	东风股份	2,416,058	27,301,455.40	0.53
22	002475	立讯精密	1,349,802	26,523,609.30	0.52
23	002385	大北农	3,264,933	26,315,359.98	0.51
24	300264	佳创视讯	1,980,000	25,957,800.00	0.51
25	300031	宝通科技	1,000,000	25,520,000.00	0.50
26	002279	久其软件	1,148,060	25,463,970.80	0.50
27	300336	新文化	1,000,000	24,980,000.00	0.49
28	000581	威孚高科	1,215,822	24,510,971.52	0.48
29	000488	晨鸣纸业	3,000,000	23,820,000.00	0.46
30	300362	天翔环境	399,948	22,957,015.20	0.45
31	600477	杭萧钢构	3,300,145	22,506,988.90	0.44
32	600373	中文传媒	1,072,451	22,253,358.25	0.43
33	002366	台海核电	399,941	21,320,854.71	0.42
34	603959	百利科技	501,517	20,787,879.65	0.41
35	300233	金城医药	799,978	20,711,430.42	0.40
36	600886	国投电力	3,000,000	19,800,000.00	0.39
37	000593	大通燃气	1,568,697	19,702,834.32	0.38
38	002792	通宇通讯	319,821	19,125,295.80	0.37
39	002267	陕天然气	1,800,000	18,900,000.00	0.37
40	000055	方大集团	999,944	18,818,946.08	0.37
41	600794	保税科技	3,492,672	18,755,648.64	0.37
42	600122	宏图高科	1,400,000	18,732,000.00	0.37
43	002494	华斯股份	1,199,930	18,538,918.50	0.36
44	300133	华策影视	1,190,242	18,532,067.94	0.36

45	000958	东方能源	1,332,700	18,457,895.00	0.36
46	600158	中体产业	1,000,000	17,750,000.00	0.35
47	300147	香雪制药	1,199,928	17,674,939.44	0.34
48	000591	太阳能	1,161,469	17,526,567.21	0.34
49	002421	达实智能	1,000,000	17,470,000.00	0.34
50	002155	湖南黄金	1,300,000	17,121,000.00	0.33
51	000838	财信发展	1,499,975	17,054,715.75	0.33
52	601021	春秋航空	350,000	16,779,000.00	0.33
53	000656	金科股份	4,363,732	16,669,456.24	0.33
54	002303	美盈森	1,351,000	16,603,790.00	0.32
55	600820	隧道股份	1,975,200	16,571,928.00	0.32
56	002099	海翔药业	1,700,000	16,184,000.00	0.32
57	300506	名家汇	300,727	15,887,407.41	0.31
58	000915	山大华特	448,390	15,859,554.30	0.31
59	600008	首创股份	4,022,602	15,647,921.78	0.31
60	002327	富安娜	1,838,209	15,643,158.59	0.31
61	000786	北新建材	1,719,800	15,615,784.00	0.30
62	600171	上海贝岭	898,300	15,603,471.00	0.30
63	002662	京威股份	1,030,600	15,572,366.00	0.30
64	600547	山东黄金	398,920	15,521,977.20	0.30
65	600776	东方通信	1,848,900	15,512,271.00	0.30
66	002500	山西证券	935,500	15,491,880.00	0.30
67	002649	博彦科技	389,800	15,424,386.00	0.30
68	601233	桐昆股份	1,412,800	15,343,008.00	0.30
69	002736	国信证券	886,700	15,295,575.00	0.30
70	002313	日海通讯	1,113,468	15,132,030.12	0.30
71	002266	浙富控股	2,700,000	14,445,000.00	0.28
72	603898	好莱客	463,500	14,410,215.00	0.28
73	600073	上海梅林	1,199,941	13,739,324.45	0.27
74	002795	永和智控	200,203	13,629,820.24	0.27
75	000716	黑芝麻	1,999,998	13,519,986.48	0.26
76	000657	中钨高新	866,700	13,130,505.00	0.26
77	000333	美的集团	546,600	12,965,352.00	0.25
78	002299	圣农发展	499,937	12,948,368.30	0.25
79	601388	怡球资源	600,000	12,882,000.00	0.25
80	002454	松芝股份	699,982	12,725,672.76	0.25
81	000902	新洋丰	997,800	12,482,478.00	0.24

82	000910	大亚科技	800,000	12,360,000.00	0.24
83	002444	巨星科技	588,148	11,951,167.36	0.23
84	002286	保龄宝	795,025	11,909,474.50	0.23
85	600688	上海石化	1,948,100	11,883,410.00	0.23
86	600549	厦门钨业	398,500	11,839,435.00	0.23
87	000401	冀东水泥	1,101,100	11,671,660.00	0.23
88	002078	太阳纸业	2,383,400	11,630,992.00	0.23
89	600871	石化油服	3,000,000	11,520,000.00	0.22
90	600835	上海机电	600,000	11,514,000.00	0.22
91	000858	五粮液	353,500	11,499,355.00	0.22
92	002007	华兰生物	366,144	11,496,921.60	0.22
93	002048	宁波华翔	499,910	11,432,941.70	0.22
94	600489	中金黄金	979,000	11,003,960.00	0.21
95	300166	东方国信	400,000	10,988,000.00	0.21
96	300484	蓝海华腾	92,270	10,767,909.00	0.21
97	600028	中国石化	2,220,776	10,482,062.72	0.20
98	002551	尚荣医疗	445,690	10,420,232.20	0.20
99	000028	国药一致	158,304	10,305,590.40	0.20
100	002260	德奥通航	393,800	10,219,110.00	0.20
101	300510	金冠电气	150,191	10,146,903.96	0.20
102	600452	涪陵电力	300,000	10,023,000.00	0.20
103	600219	南山铝业	1,338,400	9,904,160.00	0.19
104	603398	邦宝益智	259,200	9,574,848.00	0.19
105	600196	复星医药	500,000	9,510,000.00	0.19
106	002447	壹桥海参	1,313,106	9,441,232.14	0.18
107	000513	丽珠集团	202,900	9,355,719.00	0.18
108	600063	皖维高新	2,100,000	9,303,000.00	0.18
109	002536	西泵股份	600,000	9,054,000.00	0.18
110	002517	恺英网络	204,875	9,030,890.00	0.18
111	002456	欧菲光	300,000	8,850,000.00	0.17
112	002584	西陇科学	645,750	8,594,932.50	0.17
113	000705	浙江震元	608,758	8,577,400.22	0.17
114	300230	永利股份	290,180	8,438,434.40	0.16
115	600161	天坛生物	300,000	8,337,000.00	0.16
116	002322	理工环科	437,100	8,278,674.00	0.16
117	300136	信维通信	393,000	8,237,280.00	0.16
118	300027	华谊兄弟	599,750	8,120,615.00	0.16

119	600108	亚盛集团	1,600,000	8,080,000.00	0.16
120	002043	兔宝宝	800,000	8,024,000.00	0.16
121	600098	广州发展	1,000,000	7,820,000.00	0.15
122	000948	南天信息	400,000	7,724,000.00	0.15
123	002045	国光电器	529,500	7,561,260.00	0.15
124	601727	上海电气	1,000,000	7,560,000.00	0.15
125	600031	三一重工	1,500,000	7,530,000.00	0.15
126	002020	京新药业	600,000	7,422,000.00	0.14
127	300335	迪森股份	440,700	7,320,027.00	0.14
128	002179	中航光电	168,900	7,316,748.00	0.14
129	300309	吉艾科技	550,900	7,315,952.00	0.14
130	600455	博通股份	145,400	7,144,956.00	0.14
131	000667	美好集团	2,000,000	7,140,000.00	0.14
132	300116	坚瑞消防	291,040	7,130,480.00	0.14
133	300039	上海凯宝	700,000	7,119,000.00	0.14
134	002022	科华生物	330,100	7,034,431.00	0.14
135	600566	济川药业	270,000	6,949,800.00	0.14
136	000655	金岭矿业	900,000	6,948,000.00	0.14
137	002498	汉缆股份	1,599,960	6,943,826.40	0.14
138	300035	中科电气	500,000	6,880,000.00	0.13
139	000524	岭南控股	499,927	6,539,045.16	0.13
140	300150	世纪瑞尔	600,000	6,498,000.00	0.13
141	002398	建研集团	484,000	6,359,760.00	0.12
142	600636	三爱富	447,800	6,206,508.00	0.12
143	300197	铁汉生态	440,000	6,098,400.00	0.12
144	601988	中国银行	1,837,300	5,897,733.00	0.12
145	603528	多伦科技	60,000	5,879,400.00	0.11
146	600826	兰生股份	224,300	5,872,174.00	0.11
147	300347	泰格医药	199,700	5,795,294.00	0.11
148	600385	山东金泰	250,900	5,730,556.00	0.11
149	000883	湖北能源	1,204,464	5,576,668.32	0.11
150	000807	云铝股份	846,100	5,541,955.00	0.11
151	600501	航天晨光	300,039	5,520,717.60	0.11
152	002262	恩华药业	272,610	5,493,091.50	0.11
153	300061	康耐特	187,800	5,416,152.00	0.11
154	600343	航天动力	227,500	5,409,950.00	0.11
155	002122	天马股份	799,901	4,975,384.22	0.10

156	601238	广汽集团	211,600	4,970,484.00	0.10
157	601398	工商银行	1,118,500	4,966,140.00	0.10
158	300363	博腾股份	200,000	4,964,000.00	0.10
159	000004	国农科技	133,200	4,905,756.00	0.10
160	000021	深科技	404,100	4,449,141.00	0.09
161	002653	海思科	276,900	4,435,938.00	0.09
162	002090	金智科技	150,000	4,405,500.00	0.09
163	601888	中国国旅	100,000	4,398,000.00	0.09
164	300424	航新科技	62,174	4,210,423.28	0.08
165	601628	中国人寿	199,012	4,143,429.84	0.08
166	601328	交通银行	696,500	3,921,295.00	0.08
167	601929	吉视传媒	972,000	3,917,160.00	0.08
168	600197	伊力特	257,900	3,878,816.00	0.08
169	300191	潜能恒信	83,004	3,795,772.92	0.07
170	300103	达刚路机	199,910	3,738,317.00	0.07
171	000620	新华联	399,911	3,659,185.65	0.07
172	600395	盘江股份	432,910	3,575,836.60	0.07
173	002479	富春环保	300,000	3,369,000.00	0.07
174	600988	赤峰黄金	176,200	3,286,130.00	0.06
175	603199	九华旅游	68,000	3,223,200.00	0.06
176	002212	南洋股份	264,676	2,985,545.28	0.06
177	300285	国瓷材料	70,000	2,792,300.00	0.05
178	600579	天华院	200,000	2,724,000.00	0.05
179	600406	国电南瑞	197,200	2,636,564.00	0.05
180	002492	恒基达鑫	200,000	2,532,000.00	0.05
181	000554	泰山石油	283,635	2,439,261.00	0.05
182	600121	郑州煤电	500,000	2,400,000.00	0.05
183	600173	卧龙地产	281,700	2,332,476.00	0.05
184	300096	易联众	111,300	2,041,242.00	0.04
185	600844	丹化科技	260,700	1,684,122.00	0.03
186	600690	青岛海尔	186,544	1,656,510.72	0.03
187	002094	青岛金王	60,800	1,623,968.00	0.03
188	002053	云南盐化	55,400	1,572,806.00	0.03
189	600855	航天长峰	48,500	1,518,050.00	0.03
190	600856	中天能源	74,902	1,450,851.74	0.03
191	300049	福瑞股份	56,055	1,332,427.35	0.03
192	300012	华测检测	86,992	1,076,960.96	0.02

193	002428	云南锗业	57,581	989,241.58	0.02
194	600333	长春燃气	99,400	916,468.00	0.02
195	002328	新朋股份	81,864	817,002.72	0.02
196	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.02
197	600303	曙光股份	50,000	742,500.00	0.01
198	600486	扬农化工	27,038	740,841.20	0.01
199	002208	合肥城建	36,861	715,840.62	0.01
200	000779	三毛派神	27,339	613,760.55	0.01
201	002101	广东鸿图	26,390	570,551.80	0.01
202	300418	昆仑万维	20,000	565,400.00	0.01
203	002343	慈文传媒	8,000	388,000.00	0.01
204	300516	久之洋	1,236	216,510.12	0.00
205	000803	金宇车城	10,000	212,400.00	0.00
206	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
207	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
208	600079	人福医药	9,995	167,616.15	0.00
209	002339	积成电子	7,200	131,328.00	0.00
210	300511	雪榕生物	1,550	103,276.50	0.00
211	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
212	300512	中亚股份	757	75,639.44	0.00
213	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
214	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
215	603339	四方冷链	1,117	60,787.14	0.00
216	000920	南方汇通	3,400	60,520.00	0.00
217	603779	威龙股份	1,125	47,205.00	0.00
218	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
219	603101	汇嘉时代	1,425	42,493.50	0.00
220	603798	康普顿	636	40,634.04	0.00
221	603029	天鹅股份	874	39,006.62	0.00
222	603028	赛福天	1,324	38,938.84	0.00
223	603726	朗迪集团	735	37,154.25	0.00
224	002793	东音股份	565	36,730.65	0.00
225	300508	维宏股份	143	36,393.50	0.00
226	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
227	300038	梅泰诺	442	25,052.56	0.00
228	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
229	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00

230	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
231	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
232	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
233	600048	保利地产	81	699.03	0.00
234	600759	洲际油气	10	75.80	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	601988	中国银行	230,736,971.51	3.79
2	601288	农业银行	188,753,276.95	3.10
3	601398	工商银行	166,558,336.31	2.73
4	002051	中工国际	166,235,448.41	2.73
5	601857	中国石油	152,588,253.84	2.50
6	600804	鹏博士	143,327,747.35	2.35
7	000876	新希望	128,303,322.38	2.11
8	002007	华兰生物	120,999,629.99	1.99
9	000858	五粮液	112,558,109.63	1.85
10	300133	华策影视	103,801,665.83	1.70
11	600521	华海药业	98,022,067.93	1.61
12	300336	新文化	97,827,439.89	1.61
13	000709	河钢股份	88,355,263.91	1.45
14	000898	鞍钢股份	86,349,292.44	1.42
15	002175	东方网络	82,492,685.01	1.35
16	600519	贵州茅台	79,986,491.64	1.31
17	002092	中泰化学	79,795,694.42	1.31
18	000963	华东医药	75,809,503.92	1.24
19	000333	美的集团	73,639,567.45	1.21
20	600036	招商银行	73,371,565.04	1.20

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	601988	中国银行	227,368,793.56	3.73
2	601398	工商银行	209,936,457.21	3.45
3	601857	中国石油	193,982,197.37	3.18
4	601288	农业银行	190,349,959.28	3.12
5	002007	华兰生物	128,006,732.73	2.10
6	600728	佳都科技	123,993,172.89	2.04
7	600978	宜华生活	119,778,518.83	1.97
8	000858	五粮液	108,097,142.83	1.77
9	002668	奥马电器	89,952,003.27	1.48
10	300133	华策影视	87,415,596.62	1.43
11	002092	中泰化学	83,498,188.41	1.37
12	600036	招商银行	80,348,783.87	1.32
13	600900	长江电力	79,229,100.08	1.30
14	600735	新华锦	78,202,302.64	1.28
15	000709	河钢股份	75,834,321.69	1.24
16	000898	鞍钢股份	71,662,978.60	1.18
17	600804	鹏博士	71,315,793.07	1.17
18	300336	新文化	70,288,783.58	1.15
19	600271	航天信息	69,385,290.81	1.14
20	002299	圣农发展	68,418,006.82	1.12

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	10,255,397,369.39
卖出股票收入（成交）总额	10,384,531,742.50

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	323,069,400.00	6.30

	其中：政策性金融债	323,069,400.00	6.30
4	企业债券	713,063,062.50	13.91
5	企业短期融资券	380,762,000.00	7.43
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,416,894,462.50	27.63

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	011605001	16 联通 SCP001	1,500,000	150,165,000.00	2.93
2	122149	12 石化 01	1,100,000	111,595,000.00	2.18
3	126018	08 江铜债	1,023,960	101,965,936.80	1.99
4	011699175	16 华电 SCP002	900,000	90,189,000.00	1.76
5	122049	10 营口港	779,930	81,401,294.10	1.59

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	2,353,680.08
2	应收证券清算款	139,325,607.83
3	应收股利	-
4	应收利息	21,830,822.57
5	应收申购款	921,777.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	164,431,887.70

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	90,572,232.78	1.77	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
275,773	16,692.24	16,191,003.39	0.35%	4,587,079,164.65	99.65%

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	1,187,699.21	0.03%

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	50~100

§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	4,407,555,959.08
本报告期基金总申购份额	534,549,115.65
减：本报告期基金总赎回份额	338,834,906.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,603,270,168.04

§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	
中信证券	2	8,052,320,706.45	39.02%	6,637,881.03	39.30%	-
招商证券	2	3,409,594,936.81	16.52%	3,175,354.77	18.80%	-
申万宏源证券	2	2,273,987,289.27	11.02%	2,117,756.56	12.54%	-
东方证券	1	1,813,900,901.70	8.79%	1,326,505.80	7.85%	-
华创证券	1	1,305,931,922.22	6.33%	563,243.77	3.33%	-
长江证券	1	824,988,763.82	4.00%	603,314.04	3.57%	-
民生证券	1	800,496,920.35	3.88%	585,403.57	3.47%	-
国海证券	1	634,236,777.42	3.07%	463,817.35	2.75%	-
国信证券	1	608,618,957.52	2.95%	566,807.06	3.36%	-
万联证券	1	418,491,922.21	2.03%	389,741.33	2.31%	-
国泰君安证券	1	318,250,166.61	1.54%	296,386.81	1.75%	-
高华证券	1	177,518,204.52	0.86%	165,323.66	0.98%	-

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，本基金还选择了东莞证券、方正证券、广州证券、海通证券、华泰证券、民族证券、平安证券、天风证券、西部证券、信达证券、中国银河证券、长城证券、中金公司、中信建投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，国海证券的部分交易单元、长江证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	18,281,696.00	100.00%	1,993,000,000.00	72.13%
申万宏源证券	-	-	420,000,000.00	15.20%
华创证券	-	-	300,000,000.00	10.86%
高华证券	-	-	50,000,000.00	1.81%

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	2016-01-04

		定报刊及网站	
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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	2016-03-04
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深圳众禄金融控股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	2016-05-10
14	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
15	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中正达广投资管理有限公司、北京汇成基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-24
16	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海天天基金销售有限公司调整申购、赎回数额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-26

§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募集的文件；
- 11.1.2 《华夏成长证券投资基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏成长证券投资基金托管协议》；
- 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