

华夏成长证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月二十九日

§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 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§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	4,541,678,483.82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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-914,806,002.58	2,773,533,049.01	1,310,810,428.46
本期利润	-1,381,712,990.56	2,329,674,549.92	1,149,255,926.34
加权平均基金份额本期利润	-0.3042	0.4597	0.1563
本期加权平均净值利润率	-27.20%	30.80%	13.93%
本期基金份额净值增长率	-22.72%	25.86%	15.27%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	172,926,087.98	1,684,427,544.36	549,726,773.12
期末可供分配基金份额利润	0.0381	0.3822	0.0838
期末基金资产净值	4,714,604,571.80	6,091,983,503.44	7,724,351,124.16
期末基金份额净值	1.038	1.382	1.178
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	453.21%	615.81%	468.73%

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
过去三个月	-4.98%	0.62%	-	-	-	-
过去六个月	-4.12%	0.55%	-	-	-	-
过去一年	-22.72%	1.22%	-	-	-	-
过去三年	12.12%	1.40%	-	-	-	-
过去五年	39.15%	1.25%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	453.21%	1.28%	-	-	-	-

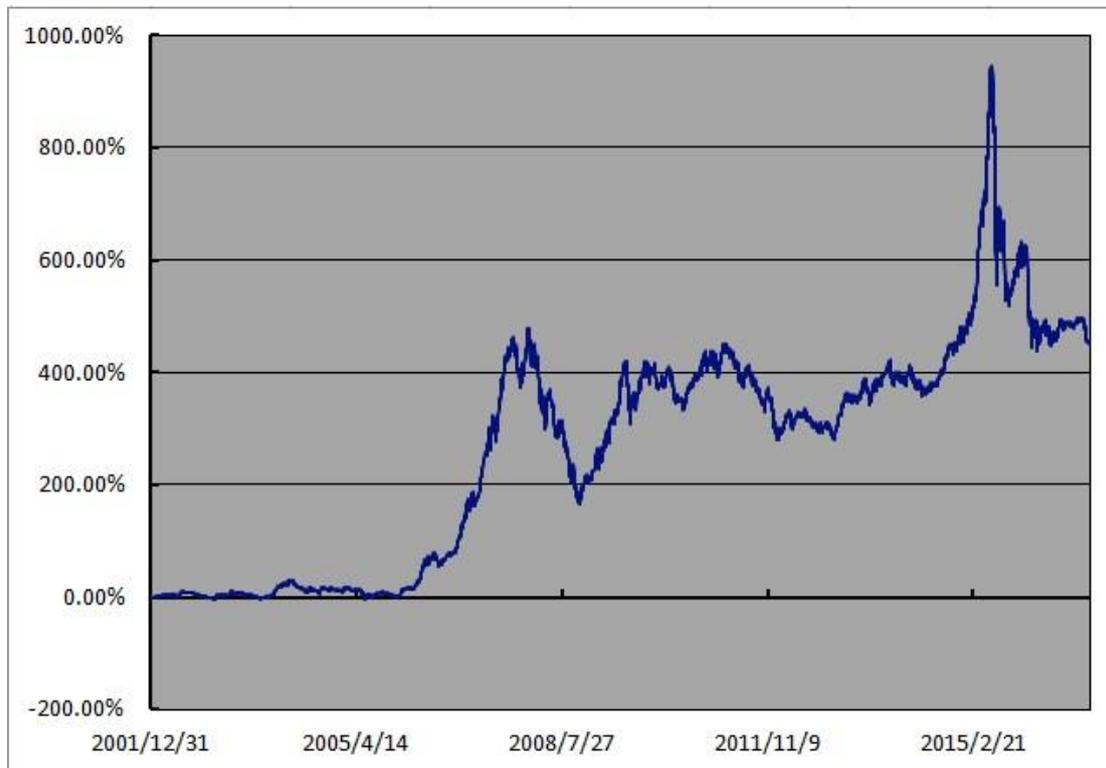
注：本基金未规定业绩比较基准。

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 12 月 31 日)

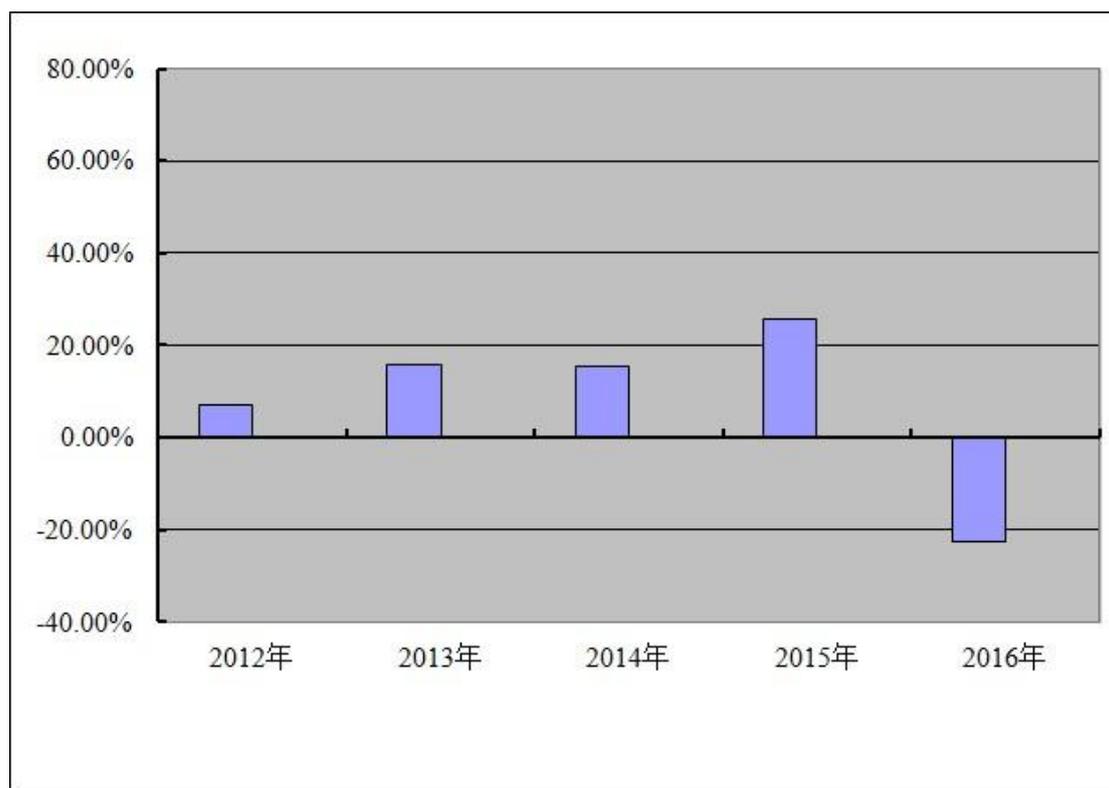


注：本基金未规定业绩比较基准。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏成长证券投资基金

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金未规定业绩比较基准。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.300	52,595,294.32	81,319,489.41	133,914,783.73	-
2015年	1.000	162,936,147.72	262,222,460.05	425,158,607.77	-
2014年	1.000	253,225,003.31	409,161,704.84	662,386,708.15	-
合计	2.300	468,756,445.35	752,703,654.30	1,221,460,099.65	-

§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，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 12 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 7，华夏医疗健康混合 A 及华夏兴华混合 A 分别在 58 只偏股型基金（股票上限 95%）中排名第 10 和第 13，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 12；固定收益类产品中，华夏理财 30 天债券在 38 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。

2016 年，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，2016 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）改进业务流程，客户可通过网上交易系统自助办理退款、重置密码、上传换卡资料等业务，还可自助办理资产证明和盖章对账单，业务处理更加高效便捷；（2）增加交易渠道，与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财，并上线华夏财富网上交易系统，增加直销定投通等功能，为客户提供更多优惠便捷的理财渠道，提高交易便利性；（3）开展“你定，我投”、“客户个性化白皮书”、“2016 活期通年底晒账单”、2016 北京马拉松等系列宣传活动，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		
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。
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。
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。

③根据本基金管理人发布的《华夏基金管理有限公司关于调整华夏成长证券投资基金基金经理的公告》，自 2017 年 1 月 13 日起，李铨汶先生不再担任本基金基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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，本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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

2016 年，国际政治经济格局重塑，“黑天鹅”事件频出，但受益于美国经

济复苏确定性提升、对新一轮财政刺激预期升温等因素，全球主要股指全年收红。商品走势波澜壮阔，供需格局变动推动能源价格上涨，风险事件爆发与平息带来以黄金为代表的贵金属价格全年整体呈倒 V 走势。

2016 年，中国经济运行整体相对稳健，主要波动因子如下：第一，由于美元加息、人民币贬值与金融去杠杆等因素，国内流动性边际宽松条件受限；第二，房地产市场历经核心城市房价带动的强势复苏，以及相伴而生的政府调控政策出台；第三，以工业商品为代表的大宗商品价格大幅上涨，推动 PPI 指数转正。

A 股方面，上证综指全年收跌 12.3%，创业板指收跌 27.7%，流动性边际趋紧，抑制创业板表现。行业方面，食品饮料、家电、银行和煤炭板块表现领先，计算机与传媒板块跌幅最深，市场偏向价值风格。从投资主线看，投资主要集中在周期反转与确定性增长两大方向：对于白酒、有色金属、煤炭、钢铁等周期底部反转的行业，市场予以价值重估；对于稳健成长、业绩夯实的个股，市场给予了确定性投资带来的估值溢价。

报告期内，本基金年初在仓位选择上出现了一定误判，没有能够躲开 1 月份的熔断大跌，随后本基金积极对持仓结构进行了调整，布局了较高比例的价值类个股和周期类个股，其余仓位基本按照“自下而上”的原则对优质成长个股进行了集中持有。从效果来看，价值和周期类个股在 2016 年的市场表现中相对收益比较明显，而坚守的部分经典成长股则因消化估值而表现不佳。行业方面，持有的煤炭、食品饮料、银行等板块表现较好，获得了绝对正收益，而传媒、计算机、通信等板块则录得较大负收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.038 元，本报告期份额净值增长率为-22.72%，同期上证综指下跌 12.31%，深证成指下跌 19.64%。

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 2017 年，经济景气度可能呈现前高后低的总体态势。在补库存和财政刺激效应下，预计 1 季度宏观经济指标表现尚可。虽然我们对地产投资增速并不悲观，但流动性边际收紧的环境，叠加投资因子的不确定性，可能制约经济平稳向好的趋势。政策方面，改革举措频出，2017 年改革措施的具体落实程度有可能为市场注入新的投资机会。基于上述宏观与政策判断，我们认为，市场风格将

从大盘价值向中盘成长切换。较之价值，成长风格股票的整体相对估值明显回落，成长风格类个股有望出现一次显著的超额收益机会。

投资策略上，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司制定了合规风险管理制度、风险隔离制度、员工违规违纪处理制度，修订了保密管理制度和员工培训制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，重点加强了投资研究和基金销售业务条线的合规教育，不断提升员工的合规守法意识；强化事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，加强了对微信等新媒体宣传材料的合规审核，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究、基金交易、市场销售、后台运作等关键业务和岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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，本基金实施利润分配的金额为 133,914,783.73 元。

5.3 托管人对本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 审计报告

安永华明(2017)审字第 60739337_B01 号

华夏成长证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏成长证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华夏基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏成长证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册会计师 汤骏 马剑英

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2017 年 3 月 10 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		474,092,608.14	398,719,112.87
结算备付金		29,131,444.62	38,087,267.39
存出保证金		2,015,142.53	4,051,656.03
交易性金融资产		4,274,678,211.25	5,629,636,840.16
其中：股票投资		3,271,305,852.45	4,218,386,276.86
基金投资		-	-
债券投资		1,003,372,358.80	1,411,250,563.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		10,000,000.00	220,000,230.00
应收证券清算款		-	21,126,045.76
应收利息		19,960,024.84	24,849,509.37
应收股利		-	-
应收申购款		1,503,671.92	3,194,232.74
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		4,811,381,103.30	6,339,664,894.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		51,903,198.94	163,936,395.17
应付赎回款		4,810,493.21	10,554,237.84
应付管理人报酬		6,164,122.85	7,712,886.26
应付托管费		1,027,353.82	1,285,481.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		29,730,106.25	60,539,487.04
应交税费		2,773,127.11	2,773,127.11
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		368,129.32	879,776.43
负债合计		96,776,531.50	247,681,390.88
所有者权益：			
实收基金		4,541,678,483.82	4,407,555,959.08
未分配利润		172,926,087.98	1,684,427,544.36
所有者权益合计		4,714,604,571.80	6,091,983,503.44
负债和所有者权益总计		4,811,381,103.30	6,339,664,894.32

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.038 元，基金份额总额 4,541,678,483.82 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-1,234,049,491.26	2,540,189,619.87
1.利息收入		68,689,356.67	95,621,009.90
其中：存款利息收入		4,459,035.59	6,645,780.23
债券利息收入		63,718,214.69	84,645,623.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		512,106.39	4,329,606.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-836,981,440.89	2,878,577,719.42
其中：股票投资收益		-871,764,379.78	2,841,038,130.76

基金投资收益		-	-
债券投资收益		9,542,181.94	7,410,691.36
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		25,240,756.95	30,128,897.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-466,906,987.98	-443,858,499.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,149,580.94	9,849,389.64
减：二、费用		147,663,499.30	210,515,069.95
1.管理人报酬		76,230,500.64	113,155,334.98
2.托管费		12,705,083.41	18,859,222.46
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		57,444,837.30	65,365,150.77
5.利息支出		858,812.73	12,705,633.99
其中：卖出回购金融资产支出		858,812.73	12,705,633.99
6.其他费用		424,265.22	429,727.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,381,712,990.56	2,329,674,549.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,381,712,990.56	2,329,674,549.92

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	-1,381,712,990.56	-1,381,712,990.56
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）	134,122,524.74	4,126,317.91	138,248,842.65
其中：1.基金申购款	950,828,414.55	107,005,522.33	1,057,833,936.88

2.基金赎回款	-816,705,889.81	-102,879,204.42	-919,585,094.23
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）	-	-133,914,783.73	-133,914,783.73
五、期末所有者权益（基金净值）	4,541,678,483.82	172,926,087.98	4,714,604,571.80
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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）	-	2,329,674,549.92	2,329,674,549.92
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）	-2,151,586,389.15	-1,385,297,173.72	-3,536,883,562.87
其中：1.基金申购款	2,743,760,089.88	1,598,517,955.51	4,342,278,045.39
2.基金赎回款	-4,895,346,479.03	-2,983,815,129.23	-7,879,161,608.26
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）	-	-425,158,607.77	-425,158,607.77
五、期末所有者权益（基金净值）	4,407,555,959.08	1,684,427,544.36	6,091,983,503.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
青岛海鹏科技投资有限公司	基金管理人的股东
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
中信证券	21,331,918,306.73	51.69%	11,711,281,568.13	25.93%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31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	99.93%	412,046,493.30	54.46%

7.4.4.1.4 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	上年度可比期间 2015年1月1日至

	2016 年 12 月 31 日		2015 年 12 月 31 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	2,003,000,000.00	71.97%	1,580,000,000.00	8.99%

7.4.4.1.5 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 12 月 31 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	17,158,246.84	51.51%	4,314,931.67	14.52%
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	9,384,009.76	25.65%	9,307,536.75	15.38%

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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	76,230,500.64	113,155,334.98
其中：支付销售机构的客户维护费	9,504,452.83	13,708,186.46

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。

7.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费	12,705,083.41		18,859,222.46	

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 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。

7.4.4.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31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	474,092,608.14	4,107,180.57	398,719,112.87	5,971,568.37

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.5 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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

7.4.5.1.1 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
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新发流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新发流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新发流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新发流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新发流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新发流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新发流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新发流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新发流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.5.2 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
300098	高新兴	2016-11-17	重大事项	15.84	2017-01-23	14.26	2,785,000	44,282,799.70	44,114,400.00	-
300212	易华录	2016-11-30	重大事项	34.00	-	-	530,200	18,219,456.96	18,026,800.00	-

002159	三特索道	2016-12-29	重大事项	32.00	2017-01-06	31.60	300,000	9,661,795.67	9,600,000.00	-
600636	三爱富	2016-05-09	重大事项	13.86	-	-	447,800	6,378,807.16	6,206,508.00	-
601727	上海电气	2016-08-31	重大事项	8.42	-	-	679,100	5,967,295.00	5,718,022.00	-
002492	恒基达鑫	2016-02-24	重大事项	12.66	-	-	200,000	2,431,849.00	2,532,000.00	-
002635	安洁科技	2016-11-08	重大事项	36.40	2017-02-08	33.50	43,700	1,580,759.00	1,590,680.00	-
000803	金宇车城	2016-06-23	重大事项	21.24	2017-01-23	23.36	10,000	209,764.68	212,400.00	-
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项	177.97	2017-03-13	195.77	340	7,908.40	60,509.80	-
300537	广信材料	2016-10-12	重大事项	48.79	2017-01-13	43.91	143	1,314.17	6,976.97	-

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。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至 2016 年 12 月 31 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 3,271,305,852.45 元，第二层次的余额为 1,003,372,358.80 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。）

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	3,271,305,852.45	67.99
	其中：股票	3,271,305,852.45	67.99
2	固定收益投资	1,003,372,358.80	20.85
	其中：债券	1,003,372,358.80	20.85
	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	10,000,000.00	0.21
	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	503,224,052.76	10.46
7	其他各项资产	23,478,839.29	0.49
8	合计	4,811,381,103.30	100.00

8.2 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	57,196,281.90	1.21
B	采矿业	106,995,571.70	2.27
C	制造业	2,016,194,130.16	42.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	73,149,430.66	1.55
E	建筑业	192,648,474.15	4.09
F	批发和零售业	90,840,457.57	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	44,006,359.48	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	254,669,511.05	5.40
J	金融业	236,927,210.35	5.03
K	房地产业	114,928,077.23	2.44
L	租赁和商务服务业	2,206,220.20	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	76,672,144.00	1.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,510,624.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	361,360.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	3,271,305,852.45	69.39

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	8,404,576	192,632,881.92	4.09
2	600056	中国医药	9,534,206	181,435,940.18	3.85
3	300156	神雾环保	7,173,032	179,397,530.32	3.81
4	002175	东方网络	8,930,665	136,192,641.25	2.89

5	002475	立讯精密	3,462,788	71,852,851.00	1.52
6	603588	高能环境	2,142,880	67,072,144.00	1.42
7	600104	上汽集团	2,784,420	65,294,649.00	1.38
8	300461	田中精机	964,673	61,575,077.59	1.31
9	601607	上海医药	3,003,741	58,753,173.96	1.25
10	600195	中牧股份	2,691,952	57,203,980.00	1.21

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	312,213,217.83	5.12
2	002051	中工国际	217,217,919.46	3.57
3	601398	工商银行	212,387,292.31	3.49
4	000858	五粮液	199,550,454.22	3.28
5	002175	东方网络	197,420,674.76	3.24
6	600056	中国医药	193,590,919.39	3.18
7	601288	农业银行	188,753,276.95	3.10
8	300156	神雾环保	166,009,729.08	2.73
9	601668	中国建筑	161,154,231.36	2.65
10	601857	中国石油	152,588,253.84	2.50
11	000895	双汇发展	149,010,539.33	2.45
12	600804	鹏博士	143,327,747.35	2.35
13	000876	新希望	134,403,546.96	2.21
14	002299	圣农发展	134,068,900.26	2.20
15	601009	南京银行	133,081,930.87	2.18
16	002048	宁波华翔	130,076,811.69	2.14
17	000651	格力电器	129,824,348.84	2.13
18	002155	湖南黄金	127,995,270.32	2.10
19	300461	田中精机	121,981,897.49	2.00
20	002007	华兰生物	120,999,629.99	1.99

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。

8.4.2 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	271,319,751.56	4.45
2	601398	工商银行	258,928,216.21	4.25
3	000858	五粮液	200,464,032.95	3.29
4	601857	中国石油	193,982,197.37	3.18
5	601288	农业银行	190,349,959.28	3.12
6	601668	中国建筑	164,048,347.08	2.69
7	600804	鹏博士	146,935,701.05	2.41
8	002007	华兰生物	141,616,280.85	2.32
9	000895	双汇发展	141,314,502.43	2.32
10	002048	宁波华翔	140,015,574.13	2.30
11	002155	湖南黄金	139,819,187.40	2.30
12	600978	宜华生活	134,571,786.83	2.21
13	000651	格力电器	133,646,398.50	2.19
14	600728	佳都科技	126,696,220.89	2.08
15	000876	新希望	125,620,280.19	2.06
16	002051	中工国际	123,214,572.99	2.02
17	002299	圣农发展	121,624,955.27	2.00
18	600521	华海药业	117,035,398.32	1.92
19	601628	中国人寿	110,845,370.67	1.82
20	600489	中金黄金	109,020,315.91	1.79

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。

8.4.3 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	20,819,356,357.33
卖出股票收入（成交）总额	20,455,678,248.37

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。

8.5 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	249,606,100.00	5.29
	其中：政策性金融债	249,606,100.00	5.29
4	企业债券	523,715,258.80	11.11
5	企业短期融资券	230,051,000.00	4.88
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,003,372,358.80	21.28

8.6 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	122149	12 石化 01	1,100,000	110,429,000.00	2.34
2	071602008	16 国泰君安 CP008	1,000,000	100,040,000.00	2.12
3	160401	16 农发 01	900,000	90,000,000.00	1.91
4	122049	10 营口港	779,930	80,309,392.10	1.70
5	122956	09 常高新	736,830	76,195,590.30	1.62

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2016 年 2 月 26 日 16 国泰君安 CP008 的发行人国泰君安证券股份有限公司收到了中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对国泰君安证券股份有限公司采取限制新增做市业务等监管措施的决定》。本基金投资该证券的决策程序符合相关法律法规的要求。

8.12.2 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。

8.12.3 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	2,015,142.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,960,024.84
5	应收申购款	1,503,671.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,478,839.29

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
268,210	16,933.29	15,905,576.62	0.35%	4,525,772,907.20	99.65%

9.2 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	901,347.64	0.02%

9.3 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	10~50

§10 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	950,828,414.55
减：本报告期基金总赎回份额	816,705,889.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,541,678,483.82

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 100,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 9 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	21,331,918,306.73	51.69%	17,158,246.84	51.51%	-
招商证券	2	3,591,855,087.32	8.70%	3,345,093.96	10.04%	-
申万宏源证券	2	2,273,987,289.27	5.52%	2,117,756.56	6.36%	-
方正证券	1	2,149,797,130.65	5.21%	1,572,149.32	4.72%	-
国海证券	1	2,059,783,617.35	4.99%	1,506,319.02	4.52%	-
东方证券	1	1,813,900,901.70	4.40%	1,326,505.80	3.98%	-
东莞证券	1	1,443,414,399.85	3.50%	1,344,254.50	4.04%	-
华创证券	1	1,305,931,922.22	3.16%	563,243.77	1.69%	-
国信证券	1	1,201,266,503.01	2.91%	1,118,736.64	3.36%	-
川财证券	1	1,160,539,653.24	2.81%	848,703.59	2.55%	-
长江证券	1	824,988,763.82	2.00%	603,314.04	1.81%	-
民生证券	1	800,496,920.35	1.94%	585,403.57	1.76%	-

万联证券	1	418,491,922.21	1.01%	389,741.33	1.17%	-
华泰证券	1	394,408,000.71	0.96%	367,309.27	1.10%	-
国泰君安证券	1	318,250,166.61	0.77%	296,386.81	0.89%	-
高华证券	1	177,518,204.52	0.43%	165,323.66	0.50%	-

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、广州证券、海通证券、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，国海证券、长江证券、东吴证券、川财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。

11.7.2 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	99.93%	2,003,000,000.00	71.97%
申万宏源证券	-	-	420,000,000.00	15.09%
方正证券	11,995.20	0.07%	-	-

华创证券	-	-	300,000,000.00	10.78%
国信证券	-	-	10,000,000.00	0.36%
高华证券	-	-	50,000,000.00	1.80%

华夏基金管理有限公司
二〇一七年三月二十九日