

**华夏港股通精选股票型发起式  
证券投资基金（LOF）  
2017 年第 2 季度报告**

**2017 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年七月二十日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至6月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 华夏港股通精选股票（LOF）  |
| 基金主代码      | 160322  |
| 交易代码       | 160322  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2016年11月11日   |
| 报告期末基金份额总额 | 239,622,910.74份   |
| 投资目标       | 在严格控制风险的前提下，把握资本市场开放政策带来的投资机会，力求基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略       | 本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。 |
| 业绩比较基准     | 本基金的业绩比较基准：恒生综合指数收益率*90%+同期人民币活期存款利率*10%  |
| 风险收益特征     | 本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的产品。   |
| 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  |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标    | 报告期                    |
|-----------|------------------------|
|           | (2017年4月1日-2017年6月30日) |
| 1.本期已实现收益 | 10,319,624.63          |

|                |                |
|----------------|----------------|
| 2.本期利润         | 16,145,224.50  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0702         |
| 4.期末基金资产净值     | 278,027,590.59 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.1603         |

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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    | 净值增长率① | 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 | 6.47%  | 0.89%     | 3.82%      | 0.59%         | 2.65% | 0.30% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华夏港股通精选股票型发起式证券投资基金（LOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年11月11日至2017年6月30日)



注：①本基金合同于2016年11月11日生效。

②根据华夏港股通精选股票型发起式证券投资基金（LOF）的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)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 |        |  |
| 李湘杰 | 本基金的基金经理、董事总经理 | 2016-11-11  | -    | 15年    | 国立台湾大学商学硕士。曾任台湾ING投信基金经理、台湾元大投信基金经理、华润元大基金投资管理部总经理、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2013年9月11日至2014年9月18日期间）、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理（2014年8月18日至2015年9月23日） |

|  |  |  |  |  |                           |
|--|--|--|--|--|---------------------------|
|  |  |  |  |  | 期间)等。2015年9月加入华夏基金管理有限公司。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------|

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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2季度，港股通南下资金及海外资金持续涌入中国香港市场，推升市场强劲上涨，大市值流动性好的股票备受青睐。4月，市场对成长股偏好很强，基本面强劲的信息技术板块表现遥遥领先，可选消费亦跑赢市场。5月，海外资金加快流入，招商银行、大型寿险公司、腾讯等海外长线基金青睐的个股强劲上涨，地产、科技、保险板块涨幅居前。6月，市场窄幅波动，行业走势分化，信息技术、汽车板块显著跑赢市场，中报业绩预期大幅增长的个股表现靓丽。

报告期内，本基金继续采取积极的仓位策略，以四条主线为核心布局：

1、科技股，聚焦智能手机供应链，包含苹果概念股。今年是苹果 10 周年，iPhone8 大改款，很受市场关注。基金买入受益于双摄像头、OLED 屏幕、3D 感应及声学升级趋势的相关个股。

2、互联网，如腾讯。我们认为，中长期看腾讯还未遇到成长瓶颈，大概率能维持高速增长。

3、汽车股，我们尤其看好 SUV 销售及奔驰、宝马高档车的销售。同时看好吉利、广汽及高档车汽车经销商等公司。

4、受惠于国内供给侧改革及环保限产相关的周期材料股，比如有色金属、造纸、水泥及钢铁等品种。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.1603 元，本报告期份额净值增长率为 6.47%，同期业绩比较基准增长率为 3.82%。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 236,298,579.99 | 83.28        |
|    | 其中：股票             | 236,298,579.99 | 83.28        |
| 2  | 固定收益投资            | -              | -            |
|    | 其中：债券             | -              | -            |
|    | 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      | 40,071,671.63  | 14.12        |
| 7  | 其他各项资产            | 7,379,707.29   | 2.60         |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 8 | 合计 | 283,749,958.91 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 236,298,579.99 元，占基金资产净值比例为 84.99%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别   | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|----------------|--------------|
| 非必需消费品 | 79,045,778.43  | 28.43        |
| 信息技术   | 54,264,611.51  | 19.52        |
| 金融     | 41,521,800.54  | 14.93        |
| 工业     | 29,014,244.48  | 10.44        |
| 房地产    | 12,291,908.32  | 4.42         |
| 保健     | 9,463,834.40   | 3.40         |
| 必需消费品  | 5,478,206.89   | 1.97         |
| 电信服务   | 2,657,918.21   | 0.96         |
| 材料     | 2,560,277.21   | 0.92         |
| 能源     | -              | -            |
| 公用事业   | -              | -            |
| 合计     | 236,298,579.99 | 84.99        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 5.3 报告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

| 序号 | 股票代码  | 股票名称   | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 00700 | 腾讯控股   | 107,400   | 26,025,518.55 | 9.36         |
| 2  | 00175 | 吉利汽车   | 960,000   | 14,031,141.89 | 5.05         |
| 3  | 02388 | 中银香港   | 409,000   | 13,258,476.11 | 4.77         |
| 4  | 00152 | 深圳国际   | 1,065,500 | 13,242,688.64 | 4.76         |
| 5  | 02382 | 舜宇光学科技 | 154,000   | 9,356,177.60  | 3.37         |
| 6  | 00921 | 海信科龙   | 621,000   | 7,168,411.66  | 2.58         |
| 7  | 03808 | 中国重汽   | 1,431,000 | 7,042,103.26  | 2.53         |
| 8  | 00881 | 中升控股   | 551,500   | 6,969,258.73  | 2.51         |
| 9  | 00005 | 汇丰控股   | 108,000   | 6,809,873.90  | 2.45         |
| 10 | 02318 | 中国平安   | 141,500   | 6,318,609.49  | 2.27         |

注：所用证券代码采用当地市场代码。



5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金   | 15,028.74    |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,436,122.82 |
| 3 | 应收股利    | 1,011,645.16 |
| 4 | 应收利息    | 8,052.06     |
| 5 | 应收申购款   | 908,858.51   |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 待摊费用    | -            |
| 8 | 其他      | -            |
| 9 | 合计      | 7,379,707.29 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告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。

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |                |
|--------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 231,512,253.19 |
| 报告期基金总申购份额   | 50,769,965.58  |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 42,659,308.03  |
| 报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额 | 239,622,910.74 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                  |               |
|------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,900.09 |
| 报告期期间买入/申购总份额    | -             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额    | -             |

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,000,900.09 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 4.17          |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,900.09 | 4.17%        | 10,000,000.00 | 4.17%        | 不少于三年      |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -            | -             | -            | -          |
| 基金经理等人员     | -             | -            | -             | -            | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -            | -             | -            | -          |
| 其他          | -             | -            | -             | -            | -          |
| 合计          | 10,000,900.09 | 4.17%        | 10,000,000.00 | 4.17%        | -          |

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

#### 1、报告期内披露的主要事项

2017年4月7日发布关于华夏港股通精选股票型发起式证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额申购业务的公告。

2017年4月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中银国际证券有限责任公司为代销机构的公告。

2017年4月26日发布关于华夏港股通精选股票型发起式证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额申购业务的公告。

2017年5月19日发布关于华夏港股通精选股票型发起式证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额申购业务的公告。

2017年6月3日发布华夏基金管理有限公司关于青岛分公司营业场所变更的公告。

2017年6月16日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海华夏财富

投资管理有限公司网上交易平台开通定期定额申购业务的公告。

2017年6月29日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增浙江金观诚财富管理有限公司为代销机构的公告。

## 2、其他相关信息

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

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至2017年6月30日数据），华夏大盘精选混合在137只普通偏股型基金（A类）中排名第5；华夏消费升级混合A在256只灵活配置型基金（股票上下限0-95%+基准股票比例30%-60%）（A类）中排名第2；华夏回报混合A和华夏回报二号混合分别在172只绝对收益目标基金（A类）中排名第2和第3；华夏全球股票(QDII)在56只QDII股票型基金（A类）中排名第3；华夏安康债券C在126只普通债券型基金（二级非A类）中排名第9；华夏可转债增强债券A在17只可转换债券型基金（A类）中排名第3。

在客户服务方面，2季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）新增开通华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币网上交易快速赎回业务，并且将单日单账户快速赎回份额上调至50万份，更好地满足了投资者的流动性需求；（2）网上交易上线中信银行和广发银行快捷支付业务，华夏财富网上交易上线定投通功能，为客户提供了更多的便捷理财方式；（3）开展“华夏基金19周年司庆”、“4月万物生长，定投让理财生花”、“知识就是红包”等活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

10.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；

10.1.2 《华夏港股通精选股票型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；

10.1.3 《华夏港股通精选股票型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；

10.1.4 法律意见书；

10.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

10.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

10.2 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。

10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一七年七月二十日