

华夏优势增长混合型证券投资基金

2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	27
7.1 期末基金资产组合情况.....	27
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	27
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.....	28
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	34
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息.....	36
§9 开放式基金份额变动.....	36
§10 重大事件揭示.....	37
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	39
§12 备查文件目录.....	39

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏优势增长混合型证券投资基金
基金简称	华夏优势增长混合
基金主代码	000021
交易代码	000021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 24 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	3,907,221,490.96 份
基金合同存续期	不定期

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	本基金主要采取“自下而上”的个股精选策略，以 GARP 模型为基础，结合严谨、深入的基本面分析和全面、细致的估值分析和市场面分析，精选出具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估、价格处于合理区间的股票进行投资。同时，考虑到我国股票市场的波动性，基金将主动进行资产配置，即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析，调整基金在股票、债券等资产类别上的投资比例，以降低投资风险，提高累积收益。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为富时中国 A600 指数，债券投资的业绩比较基准为中债综合指数（财富）。基准收益率=富时中国 A600 指数收益率×80%+中债综合指数（财富）收益率×20%。
风险收益特征	本基金风险高于货币市场基金、债券基金，属于较高风险、较高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqingl.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》
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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-55,997,672.20
本期利润	582,945,148.75
加权平均基金份额本期利润	0.1452
本期加权平均净值利润率	8.90%
本期基金份额净值增长率	9.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	2,798,127,686.55
期末可供分配基金份额利润	0.7161
期末基金资产净值	6,736,454,051.81
期末基金份额净值	1.724
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	254.67%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	6.95%	0.84%	4.01%	0.50%	2.94%	0.34%
过去三个月	4.30%	0.86%	3.20%	0.50%	1.10%	0.36%
过去六个月	9.18%	0.76%	6.09%	0.46%	3.09%	0.30%
过去一年	5.06%	0.75%	9.53%	0.54%	-4.47%	0.21%
过去三年	48.49%	1.92%	48.47%	1.40%	0.02%	0.52%
自基金合同生效起至今	254.67%	1.69%	115.03%	1.49%	139.64%	0.20%

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

华夏优势增长混合型证券投资基金

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

(2006 年 11 月 24 日至 2017 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、

境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

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

在《中国证券报》主办的第十四届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2016 年度被动投资金牛基金公司”奖。

在客户服务方面，2017 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）下调旗下开放式基金在直销机构及华夏财富的申购、赎回等业务最低数量限制，更好地满足客户理财需求；（2）新增开通华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币网上交易快速赎回业务，并且将单日单账户快速赎回份额上调至 50 万份，更好地满足了投资者的流动性需求；（3）网上交易上线中信银行和广发银行快捷支付业务，并与花旗银行、青岛农商银行、国美基金等代销机构合作，拓宽客户交易渠道，提高客户交易便利性；（4）开展“华夏基金 19 周年司庆”、“4 月万物生长，定投让理财生花”、“知识就是红包”等多项客户活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑晓辉	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2013-05-10	-	14 年	北京大学金融学博士。曾任长盛基金研究员、基金经理助理、同盛证券投资基金基金经理(2006 年 11 月 29 日至 2008 年 4 月 26 日期间) 等。2008 年 5 月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资经理、机构投资部总经理助理、机构投资部副总经理、股票投资部副总经理，华夏策略精选灵活配置混

					合型证券投资基金基金经理（2015 年 6 月 16 日至 2016 年 9 月 14 日期间）等。
孙轶佳	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2015-11-19	-	9 年	上海交通大学金融学硕士。曾任中国国际金融有限公司研究部高级经理等。2011 年 8 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理等。
刘平	本基金的基金经理、股票投资部总监	2015-11-30	-	10 年	金融学硕士。2007 年 2 月加入华夏基金管理有限公司，曾任行业研究员、投资经理、机构投资部总监等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，国际方面，美国经济继续呈现复苏态势，美联储分别于 3 月、6 月加息 25 个 BP，并表示今年可能继续加息和启动缩表，特朗普执政之后政策执行的不确定性增加，美元指数不断下跌，

人民币的实际有效汇率指数保持平稳；欧日经济数据有所改善。国内方面，PPI 高位回落，各行业补库存带来的边际效应减弱，但同时出口持续改善，基建投资有所反弹，地产投资相对平稳，经济增长仍表现出较强的韧性；银监会出台的一系列强监管措施造成了流动性的阶段性紧张，但央行整体上坚持了稳健的货币政策取向，维持了流动性的相对稳定。

A 股市场在上半年整体呈现出震荡格局，估值较低的大盘蓝筹股以及业绩增长较为确定的消费股表现较好，受益于经济表现超预期的部分周期股阶段性有所表现，而估值较高、增长不确定性较大的部分中小股票跌幅较大。

报告期内，本基金保持了较高仓位，并进一步优化了组合结构。具体而言，本基金减持了一些估值偏贵、涨幅偏大的个股，增持了一些业绩增长较为确定、估值相对较为合理的优质个股，特别注重挑选了一批具有全球竞争力且在国际范围内估值合理的优质成长股。

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 1.724 元，本报告期份额净值增长率为 9.18%，同期业绩比较基准增长率为 6.09%。

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，世界经济金融形势仍然充满不确定性。美、欧、日等世界主要经济体的经济增长整体上处于缓慢复苏过程中，但是美联储缩表进程以及欧洲央行是否加息，使得这一进程充满变数。国内经济短期内表现出较强的韧性，但是在史上最严的房地产调控政策下，今年晚些时候国内经济增长的压力将逐渐显现，因此市场不具备大幅上涨的基础，但是考虑到全球范围内的超低利率环境以及中国货币政策、财政政策空间仍然较大，市场也不具备大幅下跌的基础，整体来看市场仍将维持震荡态势，结构性机会可能较多。那些具有国际竞争力、国际范围内估值相对合理、增长较为确定的行业和个股将持续表现，同时，随着供给侧改革和国企改革的进一步推进，改革相关领域也可能逐渐受到投资者的关注。长期来看，受益于经济转型、治理结构良好、具有持续创新能力的企业有望逐步胜出。

本基金将秉承“以业绩增长”为核心的成长型投资理念，重点研究并跟踪业绩增长较为确定、行业成长空间较大、估值相对较为合理的个股，同时注重“自上而下”的大类资产配置，密切关注宏观刺激政策、行业景气演变催生的投资机会，在控制整体风险的基础上，不断优化投资组合。

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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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：华夏优势增长混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	150,123,657.71	495,856,795.15
结算备付金		410,933,628.35	15,138,235.84
存出保证金		1,091,423.86	1,551,715.49
交易性金融资产	6.4.7.2	6,204,377,929.51	5,971,294,914.25
其中：股票投资		6,203,746,030.02	5,710,639,501.66
基金投资		-	-
债券投资		631,899.49	260,655,412.59
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	31,620,135.81	-
应收证券清算款		4,982,724.67	49,408,752.50
应收利息	6.4.7.5	119,105.77	6,417,984.54
应收股利		-	-
应收申购款		515,678.05	568,852.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,803,764,283.73	6,540,237,250.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	15,157,731.83
应付赎回款		13,814,982.81	7,976,450.16
应付管理人报酬		8,092,506.05	8,328,431.06
应付托管费		1,348,751.02	1,388,071.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	43,907,706.66	43,772,153.86

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	146,285.38	140,061.68
负债合计		67,310,231.92	76,762,900.46
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	3,907,221,490.96	4,094,214,512.35
未分配利润	6.4.7.10	2,829,232,560.85	2,369,259,837.23
所有者权益合计		6,736,454,051.81	6,463,474,349.58
负债和所有者权益总计		6,803,764,283.73	6,540,237,250.04

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.724 元，基金份额总额 3,907,221,490.96 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏优势增长混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		659,819,707.49	-1,356,172,673.32
1.利息收入		2,320,497.74	5,999,550.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,987,871.79	2,278,924.32
债券利息收入		89,406.48	3,499,695.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		243,219.47	220,930.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,829,175.92	-651,042,308.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-22,846,137.49	-676,131,256.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-72,008.63	-175,305.40
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	40,747,322.04	25,264,253.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	638,942,820.95	-711,753,052.40
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	727,212.88	623,136.60
减：二、费用		76,874,558.74	78,635,149.02
1.管理人报酬		48,625,711.96	50,738,418.23
2.托管费		8,104,285.34	8,456,403.09

3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	20,006,842.77	19,298,947.79
5.利息支出		-	1,749.98
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,749.98
6.其他费用	6.4.7.21	137,718.67	139,629.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		582,945,148.75	-1,434,807,822.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		582,945,148.75	-1,434,807,822.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏优势增长混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,094,214,512.35	2,369,259,837.23	6,463,474,349.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	582,945,148.75	582,945,148.75
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）	-186,993,021.39	-122,972,425.13	-309,965,446.52
其中：1.基金申购款	167,066,180.93	104,706,532.00	271,772,712.93
2.基金赎回款	-354,059,202.32	-227,678,957.13	-581,738,159.45
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）	3,907,221,490.96	2,829,232,560.85	6,736,454,051.81
项目	上年度可比期间 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）	4,245,255,305.69	4,166,667,343.49	8,411,922,649.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,434,807,822.34	-1,434,807,822.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	31,684,811.80	7,853,225.43	39,538,037.23

值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	339,070,154.24	198,948,365.83	538,018,520.07
2.基金赎回款	-307,385,342.44	-191,095,140.40	-498,480,482.84
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）	4,276,940,117.49	2,739,712,746.58	7,016,652,864.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏优势增长股票型证券投资基金（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[2006]233号《关于同意华夏优势增长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏优势增长股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 14,101,845,040.96 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京（验）报字（06）第 020 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏优势增长股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 14,102,025,101.39 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据基金管理人 2015 年 7 月 3 日刊登的《华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，华夏优势增长股票型证券投资基金自 2015 年 7 月 15 日起更名为华夏优势增长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同有关规定，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、权证、债券、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。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 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

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。
- 3、存款利息收入不征收增值税。
- 4、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- 5、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 6、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，

减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

7、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

8、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	150,123,657.71
定期存款	-
其他存款	-
合计	150,123,657.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,487,304,205.10	6,203,746,030.02	716,441,824.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	602,900.00	631,899.49
	银行间市场	-	-
	合计	602,900.00	631,899.49
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,487,907,105.10	6,204,377,929.51	716,470,824.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

银行间同业市场买入返售金融资产	31,620,135.81	-
合计	31,620,135.81	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	91,163.84
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	22,920.20
应收债券利息	1,803.74
应收买入返售证券利息	2,726.89
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	491.10
合计	119,105.77

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	43,907,284.35
银行间市场应付交易费用	422.31
合计	43,907,706.66

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	52,065.83
预提费用	94,219.55
合计	146,285.38

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,094,214,512.35	4,094,214,512.35
本期申购	167,066,180.93	167,066,180.93
本期赎回（以“-”号填列）	-354,059,202.32	-354,059,202.32
本期末	3,907,221,490.96	3,907,221,490.96

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	2,986,244,254.59	-616,984,417.36	2,369,259,837.23
本期利润	-55,997,672.20	638,942,820.95	582,945,148.75
本期基金份额交易产生的变动数	-132,118,895.84	9,146,470.71	-122,972,425.13
其中：基金申购款	118,453,025.84	-13,746,493.84	104,706,532.00
基金赎回款	-250,571,921.68	22,892,964.55	-227,678,957.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,798,127,686.55	31,104,874.30	2,829,232,560.85

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	222,485.17
其他	11,385.18
合计	1,987,871.79

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	7,542,309,503.67
买卖股票差价收入	-22,846,137.49

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	266,422,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	260,072,008.63
减：应收利息总额	6,422,000.00
买卖债券差价收入	-72,008.63

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	40,747,322.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	40,747,322.04

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	638,942,820.95
——股票投资	638,894,325.42
——债券投资	48,495.53
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	638,942,820.95

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	727,212.88
合计	727,212.88

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	20,006,842.77
银行间市场交易费用	-
合计	20,006,842.77

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	39,671.58
银行费用	24,699.12
银行间账户维护费	18,000.00
其他	800.00
合计	137,718.67

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国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

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	4,753,115,106.49	31.92%	966,380,378.42	7.16%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	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	3,925,668.00	35.13%	2,969,060.68	6.76%
关联方名称	上年度可比期间			

	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	899,990.72	7.98%	452,007.65	1.16%

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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	48,625,711.96	50,738,418.23
其中：支付销售机构的客户维护费	8,064,981.05	8,367,300.72

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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,104,285.34	8,456,403.09

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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	150,123,657.71	1,754,001.44	323,984,012.43	2,143,947.16

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

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：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
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新发流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新发流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科	2017-06-30	2017-07-12	新发	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

	微			流通受限						
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新发流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300145	中金环境	2017-06-28	重大事项	16.92	-	-	14,420,844.00	154,151,622.58	244,000,680.48	-
600643	爱建集团	2017-04-14	重大事项	16.31	2017-08-02	16.48	5,298,390.00	68,487,547.39	86,416,740.90	-
000403	ST 生化	2017-06-22	重大事项	30.93	-	-	1,512,717.00	47,041,207.24	46,788,336.81	-
300109	新开源	2017-03-27	重大事项	42.11	-	-	903,362.00	42,342,397.27	38,040,573.82	-
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项	12.08	2017-07-06	12.61	1,514,233.00	18,417,043.79	18,291,934.64	-
002638	勤上股份	2017-04-26	重大事项	8.14	-	-	2,000,000.00	20,759,849.54	16,280,000.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	378,150.00	4,816,760.00	3,906,289.50	-
603501	韦尔股份	2017-06-05	重大事项	20.15	-	-	414.00	2,906.28	8,342.10	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。截至本期末，本基金持有极少量债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	6,203,746,030.02	92.09	5,710,639,501.66	88.35
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	6,203,746,030.02	92.09	5,710,639,501.66	88.35

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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	+5%	312,575,743.72	252,181,840.39
	-5%	-312,575,743.72	-252,181,840.39

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2017 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 6,079,920,614.79 元，第二层次的余额为 124,457,314.72 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2016 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 5,711,294,914.25 元，第二层次的余额为 260,000,000.00 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票、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。

6.4.14.5 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税

政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,203,746,030.02	91.18
	其中：股票	6,203,746,030.02	91.18
2	固定收益投资	631,899.49	0.01
	其中：债券	631,899.49	0.01
	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	31,620,135.81	0.46
	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	561,057,286.06	8.25
7	其他各项资产	6,708,932.35	0.10
8	合计	6,803,764,283.73	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,688,200.00	0.11
B	采矿业	163,248,891.64	2.42
C	制造业	4,611,669,564.53	68.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,250,409.83	1.35
E	建筑业	13,825,997.74	0.21
F	批发和零售业	379,334,678.69	5.63

G	交通运输、仓储和邮政业	138,390,822.00	2.05
H	住宿和餐饮业	4,619,673.60	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	198,824,192.61	2.95
J	金融业	290,087,610.50	4.31
K	房地产业	46,343,136.12	0.69
L	租赁和商务服务业	152,053,484.12	2.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	98,355,504.64	1.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,053,864.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	6,203,746,030.02	92.09

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	600703	三安光电	14,174,500	279,237,650.00	4.15
2	000858	五粮液	4,713,594	262,358,642.04	3.89
3	300145	中金环境	14,420,844	244,000,680.48	3.62
4	300156	神雾环保	6,737,442	220,718,599.92	3.28
5	002456	欧菲光	10,916,235	198,347,989.95	2.94
6	601607	上海医药	6,588,236	190,268,255.68	2.82
7	000568	泸州老窖	3,451,284	174,565,944.72	2.59
8	002304	洋河股份	1,773,734	153,977,848.54	2.29
9	600298	安琪酵母	5,338,066	138,095,767.42	2.05
10	002635	安洁科技	3,506,239	126,995,976.58	1.89
11	000820	神雾节能	2,974,875	112,985,752.50	1.68
12	000333	美的集团	2,582,500	111,150,800.00	1.65
13	002475	立讯精密	3,717,688	108,705,197.12	1.61
14	000596	古井贡酒	2,102,354	107,114,936.30	1.59
15	002094	青岛金王	5,013,301	106,933,710.33	1.59
16	000968	蓝焰控股	6,081,000	87,931,260.00	1.31
17	600116	三峡水利	7,749,603	86,873,049.63	1.29
18	600643	爱建集团	5,298,390	86,416,740.90	1.28
19	300097	智云股份	3,158,613	85,282,551.00	1.27
20	600563	法拉电子	1,648,953	81,474,767.73	1.21
21	600690	青岛海尔	5,292,800	79,656,640.00	1.18
22	000963	华东医药	1,557,996	77,432,401.20	1.15
23	000639	西王食品	3,683,454	72,895,554.66	1.08
24	600519	贵州茅台	152,124	71,779,709.40	1.07

25	600036	招商银行	3,000,000	71,730,000.00	1.06
26	000069	华侨城 A	7,036,300	70,785,178.00	1.05
27	600885	宏发股份	1,716,892	68,486,821.88	1.02
28	603369	今世缘	4,958,223	65,448,543.60	0.97
29	601111	中国国航	6,254,512	60,981,492.00	0.91
30	600702	沱牌舍得	2,209,253	58,788,222.33	0.87
31	002180	纳思达	2,428,856	58,681,160.96	0.87
32	002043	兔宝宝	4,203,176	58,171,955.84	0.86
33	600332	白云山	1,971,498	57,252,301.92	0.85
34	002583	海能达	3,525,700	56,728,513.00	0.84
35	601318	中国平安	1,128,700	55,994,807.00	0.83
36	600079	人福医药	2,838,563	55,692,606.06	0.83
37	000049	德赛电池	1,023,860	53,046,186.60	0.79
38	601933	永辉超市	6,813,700	48,240,996.00	0.72
39	300628	亿联网络	157,400	47,843,304.00	0.71
40	000403	ST 生化	1,512,717	46,788,336.81	0.69
41	002050	三花智控	2,847,600	46,472,832.00	0.69
42	000925	众合科技	2,221,700	46,144,709.00	0.68
43	600104	上汽集团	1,472,200	45,711,810.00	0.68
44	603833	欧派家居	381,478	41,909,173.08	0.62
45	300433	蓝思科技	1,425,843	41,477,772.87	0.62
46	000799	酒鬼酒	2,251,371	41,380,198.98	0.61
47	300058	蓝色光标	5,276,769	41,264,333.58	0.61
48	002027	分众传媒	2,973,400	40,913,984.00	0.61
49	601225	陕西煤业	5,687,088	40,207,712.16	0.60
50	603515	欧普照明	1,106,700	39,974,004.00	0.59
51	002387	黑牛食品	2,588,700	39,917,754.00	0.59
52	002188	巴士在线	1,517,927	39,010,723.90	0.58
53	300604	长川科技	1,047,820	38,926,513.00	0.58
54	600594	益佰制药	2,509,373	38,293,031.98	0.57
55	300109	新开源	903,362	38,040,573.82	0.56
56	600109	国金证券	3,210,101	37,622,383.72	0.56
57	600518	康美药业	1,655,600	35,992,744.00	0.53
58	601155	新城控股	1,923,578	35,663,136.12	0.53
59	002831	裕同科技	462,043	34,653,225.00	0.51
60	600029	南方航空	3,958,800	34,441,560.00	0.51
61	603808	歌力思	1,096,991	32,383,174.32	0.48
62	300415	伊之密	2,176,708	31,431,663.52	0.47
63	300031	宝通科技	1,676,023	30,822,062.97	0.46
64	300450	先导智能	579,105	29,980,265.85	0.45
65	002439	启明星辰	1,531,100	28,478,460.00	0.42
66	600998	九州通	1,262,600	27,221,656.00	0.40
67	300308	中际装备	653,800	26,890,794.00	0.40

68	600566	济川药业	681,896	25,932,504.88	0.38
69	002292	奥飞娱乐	1,464,800	24,755,120.00	0.37
70	002008	大族激光	668,300	23,149,912.00	0.34
71	300113	顺网科技	847,031	22,785,133.90	0.34
72	002271	东方雨虹	600,000	22,260,000.00	0.33
73	300424	航新科技	466,787	22,018,342.79	0.33
74	300418	昆仑万维	925,800	21,173,046.00	0.31
75	002466	天齐锂业	384,000	20,870,400.00	0.31
76	002450	康得新	915,995	20,628,207.40	0.31
77	300309	吉艾科技	950,700	19,603,434.00	0.29
78	600009	上海机场	520,000	19,401,200.00	0.29
79	600315	上海家化	574,350	18,637,657.50	0.28
80	601600	中国铝业	4,064,000	18,369,280.00	0.27
81	600188	兖州煤业	1,495,434	18,304,112.16	0.27
82	002127	南极电商	1,514,233	18,291,934.64	0.27
83	002529	海源机械	1,020,996	17,867,430.00	0.27
84	603868	飞科电器	288,600	17,847,024.00	0.26
85	002385	大北农	2,704,400	17,010,676.00	0.25
86	603208	江山欧派	312,608	16,890,210.24	0.25
87	603179	新泉股份	376,171	16,517,668.61	0.25
88	000978	桂林旅游	1,768,700	16,378,162.00	0.24
89	002638	勤上股份	2,000,000	16,280,000.00	0.24
90	002410	广联达	860,257	16,172,831.60	0.24
91	300571	平治信息	110,200	15,280,332.00	0.23
92	300078	思创医惠	1,404,497	15,070,252.81	0.22
93	002142	宁波银行	750,000	14,475,000.00	0.21
94	603799	华友钴业	235,400	14,307,612.00	0.21
95	002517	恺英网络	403,527	14,200,115.13	0.21
96	600477	杭萧钢构	905,392	13,816,281.92	0.21
97	000581	威孚高科	526,300	13,631,170.00	0.20
98	600967	内蒙一机	1,000,000	13,630,000.00	0.20
99	002185	华天科技	1,878,200	13,598,168.00	0.20
100	002460	赣锋锂业	290,000	13,412,500.00	0.20
101	002712	思美传媒	582,600	12,572,508.00	0.19
102	600004	白云机场	676,900	12,495,574.00	0.19
103	002174	游族网络	389,600	12,373,696.00	0.18
104	002581	未名医药	587,700	12,018,465.00	0.18
105	002640	跨境通	555,760	11,809,900.00	0.18
106	600309	万华化学	407,700	11,676,528.00	0.17
107	600110	诺德股份	817,200	11,514,348.00	0.17
108	300166	东方国信	852,776	11,452,781.68	0.17
109	601021	春秋航空	329,200	11,070,996.00	0.16
110	600066	宇通客车	503,000	11,050,910.00	0.16

111	002850	科达利	121,500	11,030,985.00	0.16
112	600231	凌钢股份	3,242,000	10,698,600.00	0.16
113	001979	招商蛇口	500,000	10,680,000.00	0.16
114	601688	华泰证券	593,200	10,618,280.00	0.16
115	603900	通灵珠宝	329,190	10,379,360.70	0.15
116	000983	西山煤电	1,171,300	10,272,301.00	0.15
117	601601	中国太保	300,000	10,161,000.00	0.15
118	002668	奥马电器	448,940	8,844,118.00	0.13
119	002311	海大集团	473,200	8,645,364.00	0.13
120	000997	新大陆	358,009	8,123,224.21	0.12
121	600062	华润双鹤	294,500	8,078,135.00	0.12
122	300426	唐德影视	340,400	8,053,864.00	0.12
123	002353	杰瑞股份	500,000	7,910,000.00	0.12
124	002415	海康威视	244,352	7,892,569.60	0.12
125	000705	浙江震元	765,700	7,886,710.00	0.12
126	300432	富临精工	303,000	7,241,700.00	0.11
127	002366	台海核电	153,490	7,200,215.90	0.11
128	000039	中集集团	399,100	7,195,773.00	0.11
129	002033	丽江旅游	695,370	7,106,681.40	0.11
130	600348	阳泉煤业	963,644	6,533,506.32	0.10
131	603986	兆易创新	83,150	6,469,901.50	0.10
132	600976	健民集团	224,675	6,068,471.75	0.09
133	002230	科大讯飞	141,700	5,653,830.00	0.08
134	002396	星网锐捷	263,100	5,090,985.00	0.08
135	300618	寒锐钴业	52,300	4,931,890.00	0.07
136	600258	首旅酒店	197,760	4,619,673.60	0.07
137	600872	中炬高新	244,300	4,470,690.00	0.07
138	300332	天壕环境	433,402	4,377,360.20	0.06
139	002714	牧原股份	160,000	4,355,200.00	0.06
140	600390	五矿资本	342,700	4,150,097.00	0.06
141	002573	清新环境	217,082	4,085,483.24	0.06
142	002340	格林美	668,850	4,046,542.50	0.06
143	000915	山大华特	106,400	3,922,968.00	0.06
144	603678	火炬电子	140,720	3,916,237.60	0.06
145	002013	中航机电	378,150	3,906,289.50	0.06
146	300258	精锻科技	228,600	3,774,186.00	0.06
147	002595	豪迈科技	168,004	3,734,728.92	0.06
148	300199	翰宇药业	229,100	3,514,394.00	0.05
149	002368	太极股份	126,900	3,513,861.00	0.05
150	002354	天神娱乐	163,000	3,504,500.00	0.05
151	300043	星辉娱乐	421,000	3,456,410.00	0.05
152	002662	京威股份	477,800	3,440,160.00	0.05
153	600562	国睿科技	121,098	3,335,038.92	0.05

154	600598	北大荒	300,000	3,333,000.00	0.05
155	600837	海通证券	203,500	3,021,975.00	0.04
156	603611	诺力股份	112,930	2,975,705.50	0.04
157	002131	利欧股份	881,650	2,900,628.50	0.04
158	600804	鹏博士	134,200	2,382,050.00	0.04
159	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
160	601878	浙商证券	2,788	47,423.88	0.00
161	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
162	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
163	002867	周大生	872	26,927.36	0.00
164	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
165	603980	吉华集团	898	23,913.74	0.00
166	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
167	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
168	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
169	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
170	002880	卫光生物	267	20,211.90	0.00
171	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
172	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
173	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
174	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
175	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
176	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
177	603326	我乐家居	378	10,572.66	0.00
178	603767	中马传动	465	10,355.55	0.00
179	603316	诚邦股份	457	9,715.82	0.00
180	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
181	603380	易德龙	347	9,455.75	0.00
182	603501	韦尔股份	414	8,342.10	0.00
183	603496	恒为科技	229	7,873.02	0.00
184	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
185	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
186	603879	永悦科技	308	7,114.80	0.00
187	603536	惠发股份	253	6,059.35	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	000858	五粮液	200,316,064.23	3.10
2	000568	泸州老窖	133,991,152.90	2.07
3	002635	安洁科技	112,242,682.58	1.74

4	000333	美的集团	105,267,042.76	1.63
5	000596	古井贡酒	103,078,257.64	1.59
6	600116	三峡水利	97,350,664.67	1.51
7	600104	上汽集团	92,221,102.71	1.43
8	300332	天壕环境	89,627,729.50	1.39
9	600690	青岛海尔	88,485,737.56	1.37
10	600068	葛洲坝	85,900,970.44	1.33
11	002456	欧菲光	84,210,622.88	1.30
12	000968	蓝焰控股	80,702,595.03	1.25
13	002460	赣锋锂业	77,901,274.85	1.21
14	300156	神雾环保	77,410,503.34	1.20
15	600563	法拉电子	76,139,818.97	1.18
16	000069	华侨城 A	73,932,549.03	1.14
17	002450	康得新	73,190,917.65	1.13
18	601318	中国平安	71,887,768.89	1.11
19	000820	神雾节能	71,866,459.24	1.11
20	000501	鄂武商 A	69,628,447.72	1.08

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	000671	阳光城	239,490,633.52	3.71
2	000028	国药一致	143,753,816.98	2.22
3	000860	顺鑫农业	116,431,872.43	1.80
4	002669	康达新材	109,877,022.79	1.70
5	600406	国电南瑞	105,269,105.12	1.63
6	600015	华夏银行	101,251,521.81	1.57
7	002299	圣农发展	95,948,812.55	1.48
8	600566	济川药业	88,218,706.07	1.36
9	300332	天壕环境	86,882,886.84	1.34
10	000501	鄂武商 A	86,406,861.00	1.34
11	600887	伊利股份	85,863,193.73	1.33
12	000709	河钢股份	85,444,854.02	1.32
13	002065	东华软件	83,551,591.00	1.29
14	600068	葛洲坝	82,291,211.43	1.27
15	000063	中兴通讯	82,133,154.74	1.27
16	002241	歌尔股份	79,261,729.59	1.23
17	600827	百联股份	73,570,502.47	1.14
18	600298	安琪酵母	70,672,870.57	1.09
19	002460	赣锋锂业	68,815,888.89	1.06
20	600104	上汽集团	67,563,831.23	1.05

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	7,396,521,706.61
卖出股票的收入（成交）总额	7,519,463,366.18

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	631,899.49	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	631,899.49	0.01

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	123001	蓝标转债	6,029	631,899.49	0.01
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,091,423.86
2	应收证券清算款	4,982,724.67
3	应收股利	-
4	应收利息	119,105.77
5	应收申购款	515,678.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,708,932.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123001	蓝标转债	631,899.49	0.01

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	300145	中金环境	244,000,680.48	3.62	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
271,639	14,383.88	10,455,614.15	0.27%	3,896,765,876.81	99.73%

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	34,500.22	0.00%

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2006 年 11 月 24 日) 基金份额总额	14,102,025,101.39
本报告期期初基金份额总额	4,094,214,512.35
本报告期基金总申购份额	167,066,180.93

减：本报告期基金总赎回份额	354,059,202.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,907,221,490.96

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	4,753,115,106.49	31.92%	3,925,668.00	35.13%	-
天风证券	2	3,207,467,123.54	21.54%	2,345,617.58	20.99%	-
方正证券	1	2,963,529,424.91	19.90%	1,278,168.45	11.44%	-
广发证券	1	1,117,246,583.69	7.50%	1,040,492.09	9.31%	-
中金公司	2	794,057,747.03	5.33%	739,505.87	6.62%	-
中国银河证券	1	690,204,889.40	4.63%	642,790.45	5.75%	-

西南证券	2	584,040,758.54	3.92%	543,916.02	4.87%	-
中投证券	2	306,836,608.06	2.06%	224,390.27	2.01%	-
申万宏源证券	2	270,764,384.30	1.82%	252,163.68	2.26%	-
国联证券	2	167,387,607.15	1.12%	155,887.02	1.39%	-
爱建证券	1	37,691,974.06	0.25%	27,563.88	0.25%	-

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，本基金还选择了中信建投证券、广州证券、财富里昂证券、高华证券、太平洋证券、西部证券、信达证券、华鑫证券、华福证券、华融证券、国泰君安证券、上海证券、安信证券、兴业证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，中信证券的部分交易单元、天风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	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-

中国银河证券	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于在直销机构及华夏财富调整旗下部分开放式基金申购、赎回等业务数量限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-16
2	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增天津国美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	2017-02-15
3	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联泰资产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	2017-02-16
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京君德汇富投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-07
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京肯特瑞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	2017-03-17
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在财通证券股份有限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	2017-05-17
7	华夏基金管理有限公司关于青岛分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-03
8	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	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-16
9	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	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-29

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 12.1.2 《华夏优势增长混合型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《华夏优势增长混合型证券投资基金托管协议》；
- 12.1.4 法律意见书；
- 12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日