

# 华夏成长证券投资基金

## 2017 年年度报告

2017 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：二〇一八年三月二十八日

## §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 2018 年 3 月 26 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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 审计报告.....	11
§7 年度财务报表.....	13
7.1 资产负债表.....	13
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
§8 投资组合报告.....	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
8.3 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.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	45
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.....	45
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.....	45
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
8.12 投资组合报告附注.....	45
§9 基金份额持有人信息.....	46
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§10 开放式基金份额变动.....	47
§11 重大事件揭示.....	47
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§13 备查文件目录.....	51

## §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(前端)	000002(后端)
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	4,398,316,713.21 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	李彬	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	田国立

### 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	486,945,519.11	-914,806,002.58	2,773,533,049.01
本期利润	789,791,556.10	-1,381,712,990.56	2,329,674,549.92
加权平均基金份额本期利润	0.1786	-0.3042	0.4597
本期加权平均净值利润率	15.78%	-27.20%	30.80%
本期基金份额净值增长率	17.11%	-22.72%	25.86%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	590,131,614.52	172,926,087.98	1,684,427,544.36
期末可供分配基金份额利润	0.1342	0.0381	0.3822
期末基金资产净值	4,988,448,327.73	4,714,604,571.80	6,091,983,503.44
期末基金份额净值	1.134	1.038	1.382
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	547.85%	453.21%	615.81%

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	1.72%	0.84%	-	-	-	-
过去六个月	5.70%	0.76%	-	-	-	-
过去一年	17.11%	0.70%	-	-	-	-

过去三年	13.91%	1.38%	-	-	-	-
过去五年	51.94%	1.21%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	547.85%	1.25%	-	-	-	-

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的历史走势对比图

(2001 年 12 月 18 日至 2017 年 12 月 31 日)

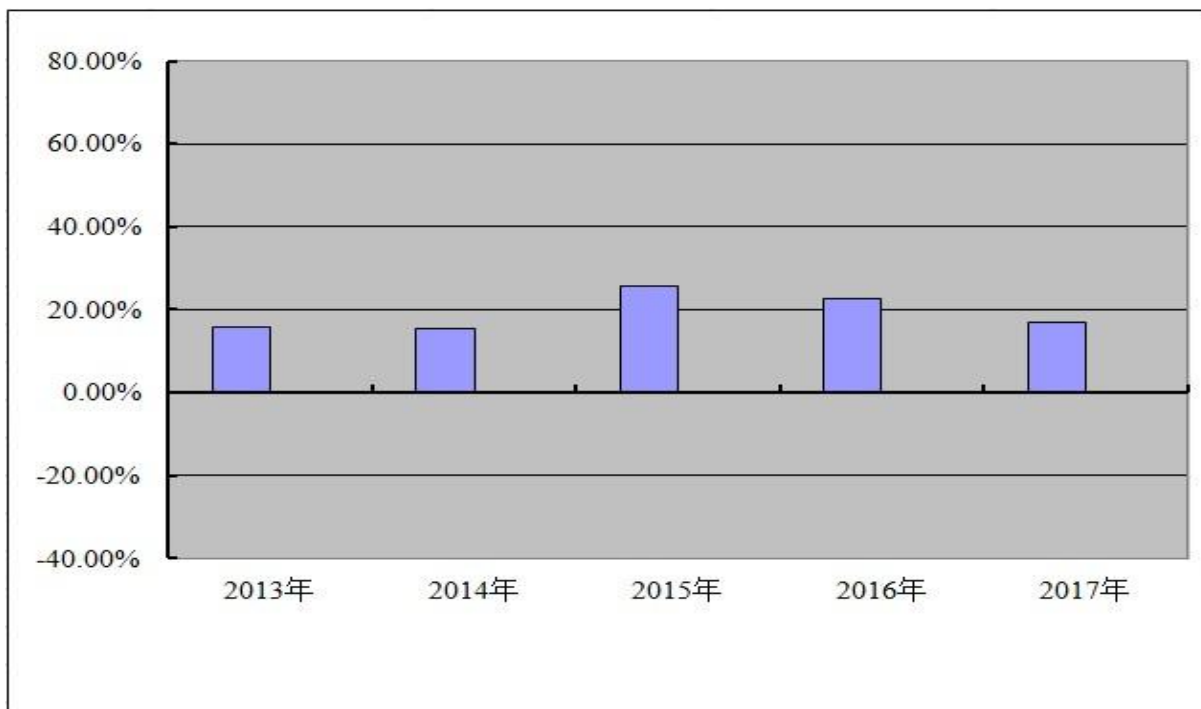


注：本基金未规定业绩比较基准。

### 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

#### 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
2017年	0.800	133,432,287.00	204,082,076.96	337,514,363.96	-
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	-
合计	2.100	348,963,729.04	547,624,026.42	896,587,755.46	-

## §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、首批公募FOF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 2017 年 12 月 31 日数据），华夏大盘精选混合在 135 只混合偏股型基金中排名第 7，华夏消费升级混合 A 在 263 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 10；华夏回报混合 A 和华夏回报二号混合分别在 174 只绝对收益目标基金（A 类）中排名第 3 和第 4；华夏安康债券 A 在 177 只普通债券型基金（二级 A 类）中排名第 7；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 5；华夏理财 30 天债券 A 在 39 只短期理财债券型基金（A 类）中排名第 8；华夏全球股票(QDII) 在 56 只 QDII 股票型基金（A 类）中排名第 4；华夏收益债券(QDII)A 及华夏大中华信用债券(QDII)A 分别在 15 只 QDII 债券型基金（A 类）中排名第 1 和第 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《中国基金报》主办的“中国基金业 20 年最佳产品创新评选”中，华夏基金荣获“十大产品创新基金公司奖”，并收获五大产品奖项，是获奖最多的基金公司。

在客户服务方面，2017 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）升级华夏基金官网、微官网、APP、微信、财富社区等多个端口的在线客服系统，进一步提升了客户的服务体验；（2）上线基金管家 APP 固定业务自助办理功能，为客户提供了更便捷的业务办理方式；（3）与花旗银行、星展银行、民生证券、国美基金、嘉实财富等基金销售机构合作，为客户提供了更多的理财渠道；（4）开展“知识就是红包”、“华夏基金 19 周年司庆”、“FOF 基金知识大挑战”、“货家三兄弟迎新年”等活动，为客户提供了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		
董阳阳	本基金的基金经理、股票投资部总监	2015-01-07	-	9 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。
李铨汶	本基金的基金经理、股票投资部总监	2014-03-17	2017-01-13	10 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，华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理（2015年2月9日至2016年3月29日期间）等。
许利明	本基金的基金经理、资产配置部总监	2015-09-01	2017-03-28	19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	2017-02-24	10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

2017 年，虽然新兴市场经济体依然存在较大不确定性，但美国、欧洲、日本等发达经济体全面温和复苏。良好的海外经济环境带动国内出口显著回暖；2017 年国内 GDP 增长 6.9%，继续保持稳中向好；制造业投资大幅改善，基建和地产投资增速稳中趋缓，社会消费品零售总额增速保持平稳，经济韧性、活力和潜力好于预期。

2017 年，以美国为代表的全球主要经济体明确出现流动性趋紧的拐点，美联储加息三次，联邦基金目标利率由 2016 年的 0.75% 提高到 1.50%，10 年美国国债收益率保持高位震荡。在海外流动性收紧、国内经济企稳的背景下，2017 年中国人民银行上调了 7 天逆回购利率 3 次共计 25 bps，6 月期 MLF 利率上调 2 次共计 20bps，1 年期 MLF 利率上调 3 次共计 25bps。政策利率的调整传导至国内金融市场，同业存单发行利率大幅提高，10 年期中债国债到期收益率最高点攀升至 4%，较 2016 年 10 月低点上行超过了 130bps，流动性趋紧叠加金融去杠杆，2017 年 M2 增速降至 8.2%，去杠杆取得一定成效。

2017 年国内 A 股市场呈现“结构性牛市”，沪深 300 全年涨幅 22%，创业板指全年下跌 10%，结构分化较为严重。食品饮料、家电、金融、周期行业表现较为强势，纺织服装、传媒、计算机板块则表现低迷。

报告期内，本基金主要持有白酒、电子、医药板块股票，取得了较好收益，并减持了部分新能源车产业链股票以及金融股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 1.134 元, 本报告期份额净值增长率为 17.11%, 同期上证综指上涨 6.56%, 深证成指上涨 8.48%。

#### 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 2018 年, 我们认为, 房地产投资和基建投资都将小幅回落, 但消费和制造业投资仍有向上的动力, 且存在巨大的结构升级空间, 温和的 PPI 与 CPI 将使企业盈利保持相对良性状态, 并从上游逐步过渡至中下游。投资策略上, 本基金将继续坚持“自下而上”的投资策略, 选取真成长股并长期持有。

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, 公司认真落实投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查管理、合规管理办法等基金行业新规, 紧密跟踪监管要求, 促进公司业务合法合规; 公司不断完善内部制度建设, 制定了投资者适当性管理制度、合规考核制度、微博微信使用合规管理制度等多项制度, 修订了反洗钱相关制度, 编制了合规管理制度汇编; 公司结合新颁布的法律法规, 以投资研究和销售业务条线为重点, 开展了多种形式的合规培训, 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, 对信息披露文件严格把关, 认真审核基金宣传推介材料, 加强了对公司和员工使用微博、微信等新媒体进行宣传的合规管理, 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, 本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价, 制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度, 建立了估值委员会, 使用可靠的估值业务系统, 设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则

及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务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技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 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 337,514,363.96 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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（2018）审字第 60739337\_A01 号

华夏成长证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了华夏成长证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏成长证券投资基金的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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏成长证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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 其他信息

华夏成长证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏成长证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏成长证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，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。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏成长证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏成长证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

徐艳 王珊珊

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2018 年 3 月 26 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	290,071,394.71	474,092,608.14
结算备付金		15,704,678.57	29,131,444.62
存出保证金		1,631,626.85	2,015,142.53
交易性金融资产	7.4.7.2	4,715,051,268.05	4,274,678,211.25
其中：股票投资		3,635,405,254.65	3,271,305,852.45
基金投资		-	-
债券投资		1,079,646,013.40	1,003,372,358.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	160,983,341.48	10,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	22,675,324.90	19,960,024.84
应收股利		-	-
应收申购款		3,543,233.14	1,503,671.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,209,660,867.70	4,811,381,103.30
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		110,000,000.00	-
应付证券清算款		60,722,760.01	51,903,198.94
应付赎回款		6,645,849.68	4,810,493.21
应付管理人报酬		6,338,281.06	6,164,122.85
应付托管费		1,056,380.17	1,027,353.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	33,180,438.43	29,730,106.25
应交税费		2,773,127.11	2,773,127.11
应付利息		120,660.55	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	375,042.96	368,129.32
负债合计		221,212,539.97	96,776,531.50
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	4,398,316,713.21	4,541,678,483.82
未分配利润	7.4.7.10	590,131,614.52	172,926,087.98

所有者权益合计		4,988,448,327.73	4,714,604,571.80
负债和所有者权益总计		5,209,660,867.70	4,811,381,103.30

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.134 元，基金份额总额 4,398,316,713.21 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏成长证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		933,654,226.94	-1,234,049,491.26
1.利息收入		55,246,391.57	68,689,356.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,575,084.40	4,459,035.59
债券利息收入		49,292,683.37	63,718,214.69
资产支持证券利息收入		106,191.78	-
买入返售金融资产收入		2,272,432.02	512,106.39
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		574,088,620.34	-836,981,440.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	540,091,502.24	-871,764,379.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,904,853.76	9,542,181.94
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	35,901,971.86	25,240,756.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	302,846,036.99	-466,906,987.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,473,178.04	1,149,580.94
<b>减：二、费用</b>		143,862,670.84	147,663,499.30
1.管理人报酬		74,957,895.36	76,230,500.64
2.托管费		12,492,982.62	12,705,083.41
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	52,194,907.96	57,444,837.30
5.利息支出		3,792,273.01	858,812.73
其中：卖出回购金融资产支出		3,792,273.01	858,812.73
6.其他费用	7.4.7.21	424,611.89	424,265.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		789,791,556.10	-1,381,712,990.56



减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		789,791,556.10	-1,381,712,990.56

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	4,541,678,483.82	172,926,087.98	4,714,604,571.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	789,791,556.10	789,791,556.10
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）	-143,361,770.61	-35,071,665.60	-178,433,436.21
其中：1.基金申购款	887,998,422.69	111,977,156.74	999,975,579.43
2.基金赎回款	-1,031,360,193.30	-147,048,822.34	-1,178,409,015.64
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）	-	-337,514,363.96	-337,514,363.96
五、期末所有者权益（基金净值）	4,398,316,713.21	590,131,614.52	4,988,448,327.73
项目	上年度可比期间 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	-	-133,914,783.73	-133,914,783.73

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）	4,541,678,483.82	172,926,087.98	4,714,604,571.80

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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%。

### 7.4.2 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 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状

况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬

已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、于2017年12月28日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》进行估值；自2017年12月28日起，

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	290,071,394.71	474,092,608.14
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	290,071,394.71	474,092,608.14

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,358,793,828.67	3,635,405,254.65	276,611,425.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	535,167,741.77	536,755,013.40
	银行间市场	555,091,530.70	542,891,000.00
	合计	1,090,259,272.47	1,079,646,013.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,449,053,101.14	4,715,051,268.05	265,998,166.91
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,319,699,971.54	3,271,305,852.45	-48,394,119.09
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	467,566,128.39	481,253,358.80	13,687,230.41
	银行间市场	524,259,981.40	522,119,000.00	-2,140,981.40
	合计	991,826,109.79	1,003,372,358.80	11,546,249.01
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,311,526,081.33	4,274,678,211.25	-36,847,870.08

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场买入返售金融资产	-	-
银行间同业市场买入返售金融资产	160,983,341.48	-
合计	160,983,341.48	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场买入返售金融资产	10,000,000.00	-
银行间同业市场买入返售金融资产	-	-
合计	10,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	74,320.73	108,881.15
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	7,773.81	14,420.01



应收债券利息	22,512,297.04	19,817,214.72
应收买入返售证券利息	80,125.59	18,511.48
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	807.73	997.48
合计	22,675,324.90	19,960,024.84

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	33,175,962.13	29,722,646.25
银行间市场应付交易费用	4,476.30	7,460.00
合计	33,180,438.43	29,730,106.25

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	25,042.96	18,129.32
预提费用	100,000.00	100,000.00
合计	375,042.96	368,129.32

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,541,678,483.82	4,541,678,483.82
本期申购	887,998,422.69	887,998,422.69
本期赎回（以“-”号填列）	-1,031,360,193.30	-1,031,360,193.30
本期末	4,398,316,713.21	4,398,316,713.21

7.4.7.10 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	1,172,730,796.88	-999,804,708.90	172,926,087.98
本期利润	486,945,519.11	302,846,036.99	789,791,556.10
本期基金份额交易产生的	-47,219,590.43	12,147,924.83	-35,071,665.60

变动数			
其中：基金申购款	260,457,096.13	-148,479,939.39	111,977,156.74
基金赎回款	-307,676,686.56	160,627,864.22	-147,048,822.34
本期已分配利润	-337,514,363.96	-	-337,514,363.96
本期末	1,274,942,361.60	-684,810,747.08	590,131,614.52

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	3,022,799.10	4,107,180.57
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	520,766.63	310,879.59
其他	31,518.67	40,975.43
合计	3,575,084.40	4,459,035.59

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	18,917,029,635.01	20,455,678,248.37
减：卖出股票成本总额	18,376,938,132.77	21,327,442,628.15
买卖股票差价收入	540,091,502.24	-871,764,379.78

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	922,557,242.07	2,748,617,830.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	904,996,627.87	2,692,132,230.96
减：应收利息总额	19,465,467.96	46,943,417.87
买卖债券差价收入	-1,904,853.76	9,542,181.94

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	35,901,971.86	25,240,756.95
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	35,901,971.86	25,240,756.95

7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	302,846,036.99	-466,906,987.98
——股票投资	325,005,545.07	-438,994,153.59
——债券投资	-22,159,508.08	-27,912,834.39
——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	302,846,036.99	-466,906,987.98

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	1,473,123.99	1,149,580.94
其他	54.05	-
合计	1,473,178.04	1,149,580.94

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	52,191,532.96	57,424,962.30
银行间市场交易费用	3,375.00	19,875.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	52,194,907.96	57,444,837.30

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
银行费用	47,211.89	46,865.22
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,400.00	1,400.00
合计	424,611.89	424,265.22

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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 10 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 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
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	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：①根据华夏基金管理有限公司于 2017 年 9 月 29 日发布的公告，经中国证监会核准，华夏基金管理有限公司股东变更为中信证券股份有限公司（出资比例 62.2%）、POWER CORPORATION OF CANADA（出资比例 13.9%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 13.9%）、青岛海鹏科技投资有限公司（更名为“天津海鹏科技咨询有限公司”，出资比例 10%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	15,276,987,056.27	40.93%	21,331,918,306.73	51.69%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	3,200,000,000.00	30.59%	2,003,000,000.00	71.97%

7.4.10.1.5 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	占期末应付佣金总量的比例
中信证券	12,350,474.91	41.22%	3,292,152.70	9.92%
关联方名称	上年度可比期间 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	占期末应付佣金总量的比例

中信证券	17,158,246.84	51.51%	4,314,931.67	14.52%
------	---------------	--------	--------------	--------

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	74,957,895.36	76,230,500.64
其中：支付销售机构的客户维护费	9,557,618.32	9,504,452.83

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,492,982.62	12,705,083.41

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	290,071,394.71	3,022,799.10	474,092,608.14	4,107,180.57

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	利润分配合计	备注
1	2017-12-07	2017-12-07	0.800	133,432,287.00	204,082,076.96	337,514,363.96	-
合计			0.800	133,432,287.00	204,082,076.96	337,514,363.96	-

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新发流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华	2017-12-28	2018-01-05	新发	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-



	控 股			流 通 受 限						
002923	润 都 股 份	2017-12-28	2018-01-05	新 发 流 通 受 限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新 疆 火 炬	2017-12-25	2018-01-03	新 发 流 通 受 限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.2 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
300156	神雾 环保	2017-07-17	重大 事项	23.64	2018-01-17	21.74	6,400,000	159,937,095.31	151,296,000.00	-
000820	神雾 节能	2017-07-17	重大 事项	26.83	2018-01-17	26.06	650,000	19,168,468.50	17,439,500.00	-
600525	长园 集团	2017-12-25	重大 事项	15.79	2018-01-10	17.30	100,000	1,559,271.87	1,579,000.00	-
002033	丽江 旅游	2017-12-14	重大 事项	9.10	2018-03-14	9.19	90,139	926,396.51	820,264.90	-
002507	涪陵 榨菜	2017-12-04	重大 事项	16.77	-	-	31,358	347,668.21	525,873.66	-
300730	科创 信息	2017-12-25	重大 事项	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣 健康	2017-12-28	重大 事项	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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 110,000,000.00 元，于 2018 年 1 月 10 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.3 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“7.4.12 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。

###### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监

测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	290,071,394.71	-	-	290,071,394.71
结算备付金	15,704,678.57	-	-	15,704,678.57
结算保证金	1,631,626.85	-	-	1,631,626.85
债券投资	487,062,132.40	547,386,881.00	45,197,000.00	1,079,646,013.40
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	160,983,341.48	-	-	160,983,341.48
应收直销申购款	51,081.58	-	-	51,081.58
卖出回购金融资产款	110,000,000.00	-	-	110,000,000.00
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	474,092,608.14	-	-	474,092,608.14
结算备付金	29,131,444.62	-	-	29,131,444.62
结算保证金	2,015,142.53	-	-	2,015,142.53
债券投资	542,896,000.00	421,972,358.80	38,504,000.00	1,003,372,358.80

资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00
应收直销申购款	5,337.94	-	-	5,337.94
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-3,490,198.66	-2,793,890.33
	利率下降 25 个基点	3,524,261.49	2,824,994.88

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	3,635,405,254.65	72.88	3,271,305,852.45	69.39
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
合计	3,635,405,254.65	72.88	3,271,305,852.45	69.39

#### 7.4.13.4.3.2 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。		
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 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	+5%	237,282,900.97	155,256,175.76
	-5%	-237,282,900.97	-155,256,175.76

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2017 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 3,467,794,902.75 元，第二层次的余额为 1,247,256,365.30 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 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。）

7.4.14.3 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，本基金将相关股票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。

7.4.14.4 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。

## §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	3,635,405,254.65	69.78
	其中：股票	3,635,405,254.65	69.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,079,646,013.40	20.72
	其中：债券	1,079,646,013.40	20.72
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	160,983,341.48	3.09
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	305,776,073.28	5.87
8	其他各项资产	27,850,184.89	0.53
9	合计	5,209,660,867.70	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	36,726,446.00	0.74
C	制造业	2,367,791,100.51	47.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	216,047,010.42	4.33
E	建筑业	17,052,684.04	0.34
F	批发和零售业	231,362,617.26	4.64
G	交通运输、仓储和邮政业	39,452,850.76	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,748,619.99	1.50
J	金融业	240,098,040.00	4.81
K	房地产业	199,094,426.00	3.99
L	租赁和商务服务业	129,918,735.51	2.60
M	科学研究和技术服务业	12,323,660.68	0.25

N	水利、环境和公共设施管理业	56,567,822.38	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	351,800.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	13,869,441.10	0.28
S	综合	-	-
	合计	3,635,405,254.65	72.88

## 8.3 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	000568	泸州老窖	4,645,042	306,572,772.00	6.15
2	002236	大华股份	11,362,963	262,370,815.67	5.26
3	000858	五粮液	2,800,009	223,664,718.92	4.48
4	002202	金风科技	11,299,789	213,001,022.65	4.27
5	601336	新华保险	3,020,200	212,018,040.00	4.25
6	600056	中国医药	7,212,737	179,525,023.93	3.60
7	300156	神雾环保	6,400,000	151,296,000.00	3.03
8	000963	华东医药	2,299,393	123,891,294.84	2.48
9	603799	华友钴业	1,195,762	95,935,985.26	1.92
10	600872	中炬高新	3,687,920	91,312,899.20	1.83
11	300309	吉艾科技	3,704,172	79,158,155.64	1.59
12	600011	华能国际	11,995,045	74,009,427.65	1.48
13	600452	涪陵电力	2,163,351	73,943,337.18	1.48
14	000002	万科 A	2,352,300	73,062,438.00	1.46
15	600027	华电国际	18,326,200	67,990,202.00	1.36
16	002127	南极电商	5,576,515	67,977,717.85	1.36
17	600079	人福医药	3,747,700	66,858,968.00	1.34
18	000546	金圆股份	3,411,200	60,889,920.00	1.22
19	600048	保利地产	4,000,000	56,600,000.00	1.13
20	600779	水井坊	1,175,500	55,013,400.00	1.10
21	600138	中青旅	2,576,605	53,773,746.35	1.08
22	600519	贵州茅台	75,600	52,730,244.00	1.06
23	002369	卓翼科技	4,999,951	51,749,492.85	1.04
24	600622	光大嘉宝	2,800,000	50,316,000.00	1.01
25	600887	伊利股份	1,500,000	48,285,000.00	0.97
26	300373	扬杰科技	1,511,315	45,294,110.55	0.91
27	300413	快乐购	1,500,000	44,775,000.00	0.90
28	000651	格力电器	1,003,000	43,831,100.00	0.88
29	300271	华宇软件	2,600,000	38,688,000.00	0.78
30	000968	蓝焰控股	2,187,400	36,726,446.00	0.74
31	000069	华侨城 A	4,000,000	33,960,000.00	0.68

32	002456	欧菲科技	1,556,755	32,053,585.45	0.64
33	603228	景旺电子	589,990	31,723,762.30	0.64
34	601021	春秋航空	830,400	30,949,008.00	0.62
35	002024	苏宁云商	2,392,800	29,407,512.00	0.59
36	600114	东睦股份	1,789,700	28,330,951.00	0.57
37	300124	汇川技术	900,000	26,118,000.00	0.52
38	603233	大参林	501,287	25,896,486.42	0.52
39	600702	沱牌舍得	506,120	23,615,559.20	0.47
40	300433	蓝思科技	776,448	23,176,972.80	0.46
41	601233	桐昆股份	898,100	20,198,269.00	0.40
42	001979	招商蛇口	977,300	19,115,988.00	0.38
43	000820	神雾节能	650,000	17,439,500.00	0.35
44	300613	富瀚微	81,500	17,105,220.00	0.34
45	600477	杭萧钢构	1,564,891	16,697,386.97	0.33
46	603515	欧普照明	350,000	14,994,000.00	0.30
47	300251	光线传媒	1,299,958	13,584,561.10	0.27
48	600885	宏发股份	306,800	12,692,316.00	0.25
49	300284	苏交科	754,202	12,323,660.68	0.25
50	603833	欧派家居	100,067	11,812,909.35	0.24
51	300661	圣邦股份	120,000	11,304,000.00	0.23
52	300212	易华录	404,000	10,948,400.00	0.22
53	601377	兴业证券	1,500,000	10,920,000.00	0.22
54	601688	华泰证券	600,000	10,356,000.00	0.21
55	300258	精锻科技	646,100	9,685,039.00	0.19
56	600070	浙江富润	1,000,000	9,650,000.00	0.19
57	002707	众信旅游	749,979	8,167,271.31	0.16
58	002624	完美世界	237,128	7,934,302.88	0.16
59	300545	联得装备	119,500	7,803,350.00	0.16
60	000888	峨眉山 A	700,000	7,539,000.00	0.15
61	600717	天津港	700,000	7,343,000.00	0.15
62	601607	上海医药	300,000	7,257,000.00	0.15
63	300003	乐普医疗	299,964	7,247,130.24	0.15
64	000978	桂林旅游	868,100	7,196,549.00	0.14
65	601555	东吴证券	700,000	6,804,000.00	0.14
66	002415	海康威视	138,523	5,402,397.00	0.11
67	600054	黄山旅游	329,264	4,698,597.28	0.09
68	002511	中顺洁柔	253,500	4,126,980.00	0.08
69	603989	艾华集团	87,100	3,346,382.00	0.07
70	603788	宁波高发	94,200	3,320,550.00	0.07
71	603899	晨光文具	118,806	2,929,755.96	0.06
72	601799	星宇股份	58,700	2,905,650.00	0.06
73	000333	美的集团	50,000	2,771,500.00	0.06
74	002159	三特索道	123,200	2,321,088.00	0.05



75	300338	开元股份	106,104	2,279,113.92	0.05
76	300477	合纵科技	100,000	2,179,000.00	0.04
77	600563	法拉电子	38,526	1,957,506.06	0.04
78	601689	拓普集团	75,725	1,873,436.50	0.04
79	600525	长园集团	100,000	1,579,000.00	0.03
80	002372	伟星新材	74,061	1,331,616.78	0.03
81	000786	北新建材	53,840	1,211,400.00	0.02
82	603686	龙马环卫	45,100	1,183,875.00	0.02
83	603816	顾家家居	20,000	1,179,400.00	0.02
84	600787	中储股份	103,900	1,142,900.00	0.02
85	300567	精测电子	8,000	1,066,720.00	0.02
86	002434	万里扬	100,074	1,050,777.00	0.02
87	600398	海澜之家	102,881	997,945.70	0.02
88	002078	太阳纸业	100,000	928,000.00	0.02
89	002583	海能达	50,000	925,500.00	0.02
90	002050	三花智控	50,000	917,000.00	0.02
91	002033	丽江旅游	90,139	820,264.90	0.02
92	000666	经纬纺机	42,050	816,611.00	0.02
93	603579	荣泰健康	12,000	755,880.00	0.02
94	000513	丽珠集团	10,000	664,500.00	0.01
95	600521	华海药业	20,000	602,400.00	0.01
96	002507	涪陵榨菜	31,358	525,873.66	0.01
97	600703	三安光电	20,000	507,800.00	0.01
98	600196	复星医药	10,000	445,000.00	0.01
99	002668	奥马电器	20,026	384,098.68	0.01
100	002572	索菲亚	10,000	368,000.00	0.01
101	300347	泰格医药	10,000	351,800.00	0.01
102	002387	黑牛食品	20,000	334,600.00	0.01
103	300308	中际旭创	5,054	295,659.00	0.01
104	002343	慈文传媒	8,000	284,880.00	0.01
105	600081	东风科技	20,000	239,800.00	0.00
106	002051	中工国际	12,408	228,679.44	0.00
107	300285	国瓷材料	10,000	200,000.00	0.00
108	002185	华天科技	22,700	193,404.00	0.00
109	000661	长春高新	1,029	188,307.00	0.00
110	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.00
111	600729	重庆百货	5,400	135,324.00	0.00
112	002659	中泰桥梁	10,057	126,617.63	0.00
113	300463	迈克生物	4,915	117,812.55	0.00
114	000899	赣能股份	14,823	87,900.39	0.00
115	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
116	300033	同花顺	772	38,584.56	0.00
117	300730	科创信息	821	34,112.55	0.00

118	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.00
119	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
120	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
121	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
122	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.00
123	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
124	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
125	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
126	603655	朗博科技	880	8,184.00	0.00
127	601965	中国汽研	971	8,136.98	0.00
128	600217	中再资环	600	3,900.00	0.00

## 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	000858	五粮液	477,692,515.38	10.13
2	601336	新华保险	373,414,459.98	7.92
3	002236	大华股份	356,896,835.34	7.57
4	601318	中国平安	341,200,278.81	7.24
5	603799	华友钴业	340,632,127.11	7.23
6	000568	泸州老窖	327,672,332.87	6.95
7	000651	格力电器	321,454,564.18	6.82
8	300418	昆仑万维	310,482,920.56	6.59
9	601601	中国太保	304,544,222.24	6.46
10	600409	三友化工	287,781,320.68	6.10
11	002460	赣锋锂业	225,366,947.85	4.78
12	601988	中国银行	214,985,828.40	4.56
13	600079	人福医药	211,883,117.20	4.49
14	300433	蓝思科技	210,001,924.21	4.45
15	002202	金风科技	203,912,200.86	4.33
16	000333	美的集团	190,337,405.87	4.04
17	601377	兴业证券	188,514,178.07	4.00
18	601688	华泰证券	186,248,523.10	3.95
19	600019	宝钢股份	175,334,857.41	3.72
20	300309	吉艾科技	170,736,962.47	3.62
21	002635	安洁科技	167,017,227.47	3.54
22	002466	天齐锂业	166,989,007.29	3.54
23	000898	鞍钢股份	160,931,052.33	3.41
24	000709	河钢股份	160,729,267.60	3.41
25	000977	浪潮信息	157,039,639.52	3.33
26	601328	交通银行	154,002,045.65	3.27

27	600104	上汽集团	153,193,314.66	3.25
28	600068	葛洲坝	149,185,388.21	3.16
29	601211	国泰君安	149,100,561.58	3.16
30	002456	欧菲科技	141,138,207.42	2.99
31	600197	伊力特	139,818,644.03	2.97
32	000513	丽珠集团	137,013,326.14	2.91
33	600741	华域汽车	133,479,275.35	2.83
34	002304	洋河股份	128,985,819.80	2.74
35	601166	兴业银行	128,880,970.36	2.73
36	300628	亿联网络	124,162,399.15	2.63
37	600887	伊利股份	123,887,444.95	2.63
38	600196	复星医药	123,686,201.59	2.62
39	600703	三安光电	122,843,071.82	2.61
40	300477	合纵科技	122,506,077.20	2.60
41	300115	长盈精密	120,110,786.16	2.55
42	000963	华东医药	119,136,657.31	2.53
43	600116	三峡水利	116,381,439.41	2.47
44	002142	宁波银行	115,516,525.61	2.45
45	000725	京东方 A	114,325,880.00	2.42
46	601607	上海医药	113,720,534.23	2.41
47	601288	农业银行	112,536,084.00	2.39
48	600779	水井坊	111,246,555.61	2.36
49	002078	太阳纸业	110,383,859.83	2.34
50	000001	平安银行	110,229,679.10	2.34
51	300258	精锻科技	108,334,173.82	2.30
52	600872	中炬高新	104,786,810.97	2.22
53	600643	爱建集团	100,965,374.46	2.14
54	600070	浙江富润	97,944,406.29	2.08
55	002573	清新环境	97,474,131.69	2.07
56	000928	中钢国际	97,253,480.35	2.06
57	002128	露天煤业	95,940,555.50	2.03
58	000820	神雾节能	94,606,665.69	2.01

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	000858	五粮液	455,557,980.99	9.66
2	601318	中国平安	358,525,116.76	7.60
3	300418	昆仑万维	324,299,436.67	6.88
4	601601	中国太保	312,131,880.83	6.62
5	600409	三友化工	294,284,921.08	6.24

6	000651	格力电器	292,866,643.26	6.21
7	002460	赣锋锂业	282,577,955.63	5.99
8	601988	中国银行	263,432,149.26	5.59
9	603799	华友钴业	257,713,371.50	5.47
10	002051	中工国际	236,048,795.45	5.01
11	000333	美的集团	231,756,245.34	4.92
12	600104	上汽集团	227,772,486.68	4.83
13	300433	蓝思科技	226,283,588.35	4.80
14	601688	华泰证券	219,562,511.51	4.66
15	601336	新华保险	190,537,966.46	4.04
16	601377	兴业证券	181,484,471.47	3.85
17	601607	上海医药	178,251,216.77	3.78
18	600019	宝钢股份	177,997,636.00	3.78
19	002635	安洁科技	167,235,042.59	3.55
20	000977	浪潮信息	167,110,096.94	3.54
21	000513	丽珠集团	166,718,273.72	3.54
22	002466	天齐锂业	162,479,928.30	3.45
23	601328	交通银行	161,471,307.85	3.42
24	600643	爱建集团	158,593,145.95	3.36
25	002175	东方网络	156,605,827.66	3.32
26	601211	国泰君安	150,745,625.73	3.20
27	600197	伊力特	149,847,489.95	3.18
28	600068	葛洲坝	148,400,124.56	3.15
29	000568	泸州老窖	148,082,578.06	3.14
30	000709	河钢股份	146,133,565.45	3.10
31	000820	神雾节能	145,540,786.08	3.09
32	000898	鞍钢股份	145,425,825.23	3.08
33	002304	洋河股份	143,000,034.08	3.03
34	600056	中国医药	139,589,612.63	2.96
35	600079	人福医药	139,280,135.77	2.95
36	600803	新奥股份	139,172,550.06	2.95
37	002456	欧菲科技	139,000,294.60	2.95
38	300477	合纵科技	136,241,484.78	2.89
39	600741	华域汽车	133,469,550.14	2.83
40	300115	长盈精密	133,040,868.02	2.82
41	600196	复星医药	132,235,886.78	2.80
42	000725	京东方 A	128,770,846.00	2.73
43	300628	亿联网络	124,956,003.11	2.65
44	601166	兴业银行	124,762,355.48	2.65
45	600703	三安光电	122,957,504.57	2.61
46	000786	北新建材	122,663,851.10	2.60
47	002078	太阳纸业	118,347,928.06	2.51
48	002142	宁波银行	114,350,947.91	2.43

49	601288	农业银行	113,792,283.46	2.41
50	300309	吉艾科技	112,771,896.51	2.39
51	300145	中金环境	112,098,891.39	2.38
52	000932	*ST 华菱	111,656,064.05	2.37
53	000001	平安银行	110,521,443.45	2.34
54	600015	华夏银行	102,471,799.54	2.17
55	300258	精锻科技	101,135,991.56	2.15
56	000933	神火股份	99,317,148.13	2.11
57	002573	清新环境	98,238,184.18	2.08
58	002475	立讯精密	97,354,753.77	2.06
59	601111	中国国航	97,312,799.43	2.06
60	600116	三峡水利	96,903,033.06	2.06
61	300156	神雾环保	95,338,899.92	2.02
62	601398	工商银行	94,775,104.05	2.01

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	18,416,031,989.90
卖出股票收入（成交）总额	18,917,029,635.01

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	237,475,980.80	4.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	354,598,400.00	7.11
	其中：政策性金融债	354,598,400.00	7.11
4	企业债券	328,430,484.50	6.58
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	158,016,000.00	3.17
7	可转债（可交换债）	1,125,148.10	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,079,646,013.40	21.64

#### 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	101564021	15 华能集 MTN002	1,000,000	98,310,000.00	1.97
2	170410	17 农发 10	900,000	89,523,000.00	1.79
3	122049	10 营口港	779,930	77,954,003.50	1.56
4	122956	09 常高新	736,830	74,132,466.30	1.49
5	101560022	15 闽高速 MTN002	600,000	59,706,000.00	1.20

#### 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 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。

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	1,631,626.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,675,324.90
5	应收申购款	3,543,233.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,850,184.89

#### 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

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	300156	神雾环保	151,296,000.00	3.03	重大事项

#### 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
243,137	18,089.87	12,832,766.41	0.29%	4,385,483,946.80	99.71%

#### 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	800,281.32	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	0

## §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	4,541,678,483.82
本报告期基金总申购份额	887,998,422.69
减：本报告期基金总赎回份额	1,031,360,193.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,398,316,713.21

## §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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2017年9月1日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

### 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 10 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

本基金管理人报告期内收到中国证券监督管理委员会北京监管局（以下简称“北京证监局”）《关于对华夏基金管理有限公司采取出具警示函的决定》。公司对此高度重视，已及时完成整改并向北京证监局提交了整改报告，同时完善了相应制度与流程。



本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	15,276,987,056.27	40.93%	12,350,474.91	41.22%	-
招商证券	1	4,363,552,954.89	11.69%	4,063,774.11	13.56%	-
方正证券	1	3,969,449,635.38	10.63%	2,902,857.61	9.69%	-
国海证券	1	2,564,331,863.93	6.87%	1,875,294.18	6.26%	-
东方证券	1	2,047,445,082.15	5.49%	1,497,298.36	5.00%	-
申万宏源证券	1	1,900,368,538.01	5.09%	1,769,803.11	5.91%	-
东莞证券	1	1,309,820,814.44	3.51%	957,871.34	3.20%	-
华创证券	1	1,198,687,895.91	3.21%	1,116,332.73	3.73%	-
国信证券	1	775,797,226.99	2.08%	567,340.85	1.89%	-
川财证券	1	772,593,303.35	2.07%	333,221.15	1.11%	-
长江证券	1	683,123,076.55	1.83%	499,569.29	1.67%	-
民生证券	1	642,633,559.30	1.72%	469,957.76	1.57%	-
平安证券	1	423,368,964.21	1.13%	394,283.32	1.32%	-
万联证券	1	414,118,674.00	1.11%	385,667.37	1.29%	-
华泰证券	1	408,664,615.98	1.09%	298,855.25	1.00%	-
国泰君安证券	1	298,374,376.91	0.80%	277,878.63	0.93%	-
高华证券	1	277,114,390.34	0.74%	202,652.77	0.68%	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-

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、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、国盛证券、万和证券、东兴证券、光大证券和安信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，安信证券、光大证券、天风证券、国盛证券、万和证券、东兴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	-	-	3,200,000,000.00	30.59%
招商证券	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-
国海证券	59,894,201.80	31.05%	2,324,100,000.00	22.22%
东方证券	-	-	3,383,100,000.00	32.35%
申万宏源证券	2,002,200.00	1.04%	1,025,000,000.00	9.80%
东莞证券	49,974,950.00	25.91%	212,100,000.00	2.03%
华创证券	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-
川财证券	-	-	200,000,000.00	1.91%
长江证券	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-
万联证券	-	-	5,000,000.00	0.05%
华泰证券	-	-	-	-
国泰君安证券	79,031,383.14	40.97%	-	-
高华证券	-	-	110,000,000.00	1.05%
中信建投证券	2,000,000.00	1.04%	-	-

11.8 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调整华夏成长证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-14
2	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	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-16

	业务数量限制的公告		
3	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
4	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
5	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	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-25
6	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
7	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管理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	2017-03-17
8	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	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-30
9	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
10	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
11	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
12	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
13	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增南京苏宁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	2017-07-20
14	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民生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	2017-08-01
15	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增通华财富（上海）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	2017-09-07
16	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-09-29
17	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挖财金融信息服务有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-10-13
18	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增嘉实财富管理有限公司为代销机构	中国证监会指定报刊及网站	2017-11-07

	的公告		
19	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信证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-11-16
20	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基煜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	2017-11-28
21	华夏成长证券投资基金第二十次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-12-04

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

13.1.2 《华夏成长证券投资基金基金合同》；

13.1.3 《华夏成长证券投资基金托管协议》；

13.1.4 法律意见书；

13.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

13.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇一八年三月二十八日