

华夏大中华企业精选灵活配置混合型  
证券投资基金（QDII）

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，普华永道中天会计师事务所（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.....	5
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.....	10
§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.....	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
§8 投资组合报告.....	36
8.1 期末基金资产组合情况.....	36
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	37
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	43
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	48
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	48
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	48
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	48
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	48
8.11 投资组合报告附注.....	48
§9 基金份额持有人信息.....	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§10 开放式基金份额变动.....	49
§11 重大事件揭示.....	50
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§13 备查文件目录.....	54

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）
基金简称	华夏大中华混合（QDII）
基金主代码	002230
交易代码	002230
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月20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	218,635,647.19份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极资产配置和组合管理，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	本基金将根据全球宏观经济发展走向、区域经济发展态势、中国大国战略部署、经济政策、法律法规等可能影响证券市场的重要因素的分析和预测，分析和比较股票、债券等不同金融工具的风险收益特征，并以此为依据，确定资产配置比例并不时进行调整，以保持基金资产配置的有效性。
业绩比较基准	30%*富时中国 A 股全股指数收益率+30%*富时中国国际（不含 B 股）全指指数收益率+40%*上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的品种。本基金为全球证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

### 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 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	摩根大通银行
注册地址		1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		270 Park Avenue, New York, New York 10017-2070
邮政编码		10017

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	28,995,684.88	24,017,083.38
本期利润	44,716,919.46	35,524,655.87
加权平均基金份额本期利润	0.1558	0.1833
本期加权平均净值利润率	11.18%	16.63%
本期基金份额净值增长率	18.62%	23.00%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	60,297,291.90	27,512,038.19
期末可供分配基金份额利润	0.2758	0.1576
期末基金资产净值	318,932,028.65	214,846,081.01
期末基金份额净值	1.459	1.230
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	45.90%	23.00%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.67%	1.05%	1.54%	0.49%	1.13%	0.56%
过去六个月	3.84%	0.94%	6.82%	0.44%	-2.98%	0.50%
过去一年	18.62%	0.85%	13.81%	0.41%	4.81%	0.44%
自基金合同生效起至今	45.90%	0.93%	24.17%	0.55%	21.73%	0.38%

#### 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

华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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

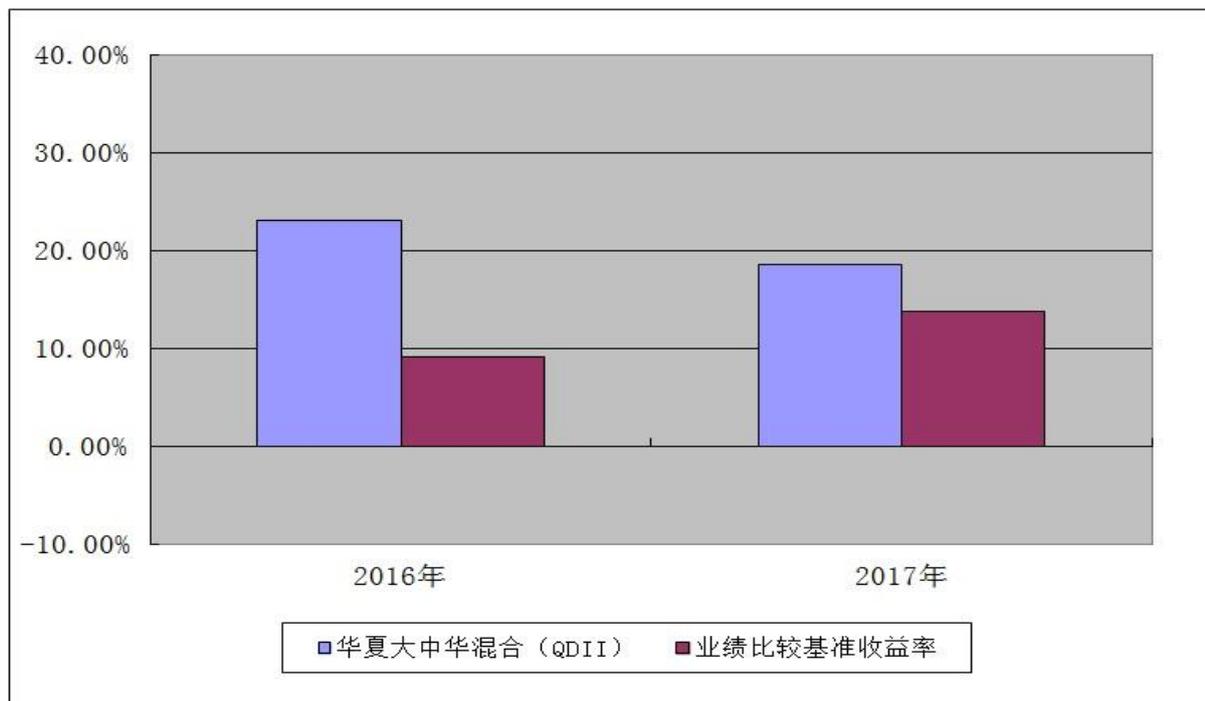
(2016 年 1 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日)



#### 3.2.3 自基金合同生效以来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

华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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：本基金合同于 2016 年 1 月 20 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

## §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		
阳琨	本基金的基金经理、公司副总经理、投资总监	2016-01-20	-	22 年	北京大学 MBA。曾任宝盈基金基金经理助理，益民基金投资部部门经理，中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部门经理等。2006 年 8 月加入华夏基金管理有限公司，曾任策略研究员、股票投资部副总经理，兴和证券投资基金基金经理（2009 年 1 月 1 日至 2012 年 1 月 12 日期间）、兴华证券投资基金基金经理（2007 年 6 月 12 日至 2013 年 4 月 11 日期间）、华夏盛世精选混合

					型证券投资基金基金经理（2009 年 12 月 18 日至 2015 年 9 月 1 日期间）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 年股票市场呈现较明显的分化格局，全年白马蓝筹表现突出，以消费、家电和金融为代表

的大型蓝筹类股票全年涨幅较大，科技类和周期类龙头个股亦有上佳表现，而估值较高的小型股票全年估值收缩，大多以股价下跌报收。股票市场的分化，反映了实体经济中行业细分龙头在经济增速放缓的背景下，依靠较全面的竞争优势提高市场份额的趋势。此外，周期类股票受益于国家供给侧改革政策，行业龙头的盈利明显恢复，经营环境大幅度好转。科技类个股也在技术创新的推动下有较好成长，但在年底受苹果手机销量不达预期的影响，股价有所承压。从经济政策方面看，2017 年党的十九大以及其后召开的中央经济工作会议为国内经济下一阶段发展确定了主基调，即以推进供给侧结构性改革为经济工作的主线，为下一步投资指明了方向。同时，防范金融风险仍是十九大提出的三大攻坚战之一，债券投资者预期金融监管力度难有大幅放松，全年债券收益率有一定程度的上升。香港市场在机构上同 A 股市场走势基本一致，且明显受益于沪港通安排带来的资金流入，全年港股表现领先全球主要市场。

本基金在全年保持了相对稳定的股票投资比例，继续坚持自下而上精选个股，个股集中度保持在较高水平上，海内外市场投资配比亦基本稳定。

#### 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 1.459 元，本报告期份额净值增长率为 18.62%，同期业绩比较基准增长率为 13.81%。

#### 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，我们认为股票市场仍有可能持续反映经济结构性变迁的趋势。总体而言，国内经济虽然受房地产市场发展放缓的影响，在 2018 年有一定的下行压力，但整体经济韧性较强，制造业投资有所恢复，因此经济大幅下行的可能性不大。虽然流动性环境整体上将维持偏紧的格局，但政策进一步大幅收紧的空间有限，更多是稳中求进，逐步达成金融去杠杆的目标。我们认为，国内股票市场的估值体系有望维持稳定，整体股票市场各风格类板块之间的比价关系处于合理区间，企业盈利仍将是市场涨跌的主要推动力，“业绩为王”的趋势仍将延续。对 2018 年的股票市场我们持谨慎乐观的态度，坚守价值、精选个股的专业投资者应该能够继续取得超额收益。对于香港及海外中概股市场，我们保持适度的乐观，原因是港股市场中相当部分个股仍有估值上的比较优势，在海外资金低配中国的背景下，我们认为港股及海外中概股市场仍有较好的投资机会。

总体而言，我们将继续强调自下而上精选个股，承担个股集中度较高的风险，争取以专业投资为持有人提供理想的回报。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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、市场营销、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

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。

#### 4.9 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，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 21147 号

华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### （1）我们审计的内容

我们审计了华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）（以下简称“华夏大中华混合（QDII）基金”）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

#### （2）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏大中华混合（QDII）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。

### 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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏大中华混合（QDII）基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏大中华混合（QDII）基金的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估华夏大中华混合（QDII）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，除非基金管理人管理层计划清算华夏大中华混合（QDII）基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏大中华混合（QDII）基金的财务报告过程。

### 6.4 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) 评价基金管理人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) 对基金管理人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，就可能导致对华夏大中华混合（QDII）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大中华混合（QDII）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。

我们与基金管理人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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

单峰 赵雪

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

2018 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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	41,940,984.36	22,710,731.43
结算备付金		6,405,901.33	376,016.58
存出保证金		181,155.82	45,517.58
交易性金融资产	7.4.7.2	272,260,744.25	192,627,239.15
其中：股票投资		272,260,744.25	192,627,239.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	6,126.95	3,452.18
应收股利		200,748.98	-
应收申购款		305,991.63	537,361.24
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		321,301,653.32	216,300,318.16
<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		-	-
应付证券清算款		8.26	-
应付赎回款		1,640,400.65	811,323.40
应付管理人报酬		499,206.16	350,528.75
应付托管费		97,067.86	68,158.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	58,691.74	162,267.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	74,250.00	61,959.09
负债合计		2,369,624.67	1,454,237.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	218,635,647.19	174,602,561.45
未分配利润	7.4.7.10	100,296,381.46	40,243,519.56
所有者权益合计		318,932,028.65	214,846,081.01
负债和所有者权益总计		321,301,653.32	216,300,318.16

注：①报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.459 元，基金份额总额 218,635,647.19 份。

②本基金合同于 2016 年 1 月 20 日生效，上年度可比期间自 2016 年 1 月 20 日至 2016 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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 20 日（基 金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		55,287,885.99	41,323,690.59

1.利息收入		351,601.20	553,918.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	351,601.20	553,918.65
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,550,382.01	26,959,048.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	35,749,592.42	26,159,846.22
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	3,800,789.59	799,201.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	15,721,234.58	11,507,572.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,469,952.29	746,238.39
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,134,620.49	1,556,913.06
<b>减：二、费用</b>		10,570,966.53	5,799,034.72
1.管理人报酬		7,172,697.59	3,656,054.45
2.托管费		1,394,691.14	710,899.31
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	1,841,511.56	1,286,260.59
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.21	162,066.24	145,820.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		44,716,919.46	35,524,655.87
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		44,716,919.46	35,524,655.87

注：本基金合同于 2016 年 1 月 20 日生效，上年度可比期间自 2016 年 1 月 20 日至 2016 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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）	174,602,561.45	40,243,519.56	214,846,081.01

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,716,919.46	44,716,919.46
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）	44,033,085.74	15,335,942.44	59,369,028.18
其中：1.基金申购款	359,017,701.86	140,694,019.96	499,711,721.82
2.基金赎回款	-314,984,616.12	-125,358,077.52	-440,342,693.64
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	218,635,647.19	100,296,381.46	318,932,028.65
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 20 日（基金合同生效日）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）	430,488,511.77	-	430,488,511.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,524,655.87	35,524,655.87
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）	-255,885,950.32	4,718,863.69	-251,167,086.63
其中：1.基金申购款	165,306,121.64	36,217,817.47	201,523,939.11
2.基金赎回款	-421,192,071.96	-31,498,953.78	-452,691,025.74
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）	174,602,561.45	40,243,519.56	214,846,081.01

注：本基金合同于 2016 年 1 月 20 日生效，上年度可比期间自 2016 年 1 月 20 日至 2016 年 12 月 31 日。

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

华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]2744 号《关于准予华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）注册的批复》，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）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，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 12 月 29 日至 2016 年 1 月 18 日期间共募集 430,380,653.97 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（16）第 0110 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》于 2016 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 430,488,511.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 107,857.80 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，境外资产托管人为摩根大通银行（JPMorgan Chase Bank, National Association）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为境内市场和境外市场依法发行的金融工具，境内市场投资工具包括依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券、可转换债券等）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。境外市场投资工具包括银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品。

#### 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(包括股票、存托凭证及信托凭证投资)、基金投资、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(包括股票、存托凭证及信托凭证投资)、基金投资、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(含股票、存托凭证及信托凭证)投资和基金投资在持有期间应取得的现金股利和基金分红收益扣除股票和基金交易所在地适用的预缴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交易所在地适用的预缴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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 7.4.4.14 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。

4、本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致本基金在正常的经营活动中，部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时，

本基金需要作出相关会计估计。

#### 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[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[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关境内外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、对基金在境内取得的股票的股息、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。基金在境内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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

7、基金在境内卖出股票按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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

8、基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

#### 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	41,940,984.36	22,710,731.43
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	41,940,984.36	22,710,731.43

##### 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		245,031,937.18	272,260,744.25	27,228,807.07
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	OTC市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		245,031,937.18	272,260,744.25	27,228,807.07
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		181,119,666.66	192,627,239.15	11,507,572.49
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	OTC市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	181,119,666.66	192,627,239.15	11,507,572.49

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

无。

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	4,592.71	3,243.62
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	1,504.65	186.12
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	29.59	22.44
合计	6,126.95	3,452.18

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	58,691.74	162,267.55
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	58,691.74	162,267.55

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	-	-

应付赎回费	4,250.00	1,959.09
预提费用	70,000.00	60,000.00
合计	74,250.00	61,959.09

## 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	174,602,561.45	174,602,561.45
本期申购	359,017,701.86	359,017,701.86
本期赎回（以“-”号填列）	-314,984,616.12	-314,984,616.12
本期末	218,635,647.19	218,635,647.19

## 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	27,512,038.19	12,731,481.37	40,243,519.56
本期利润	28,995,684.88	15,721,234.58	44,716,919.46
本期基金份额交易产生的变动数	3,789,568.83	11,546,373.61	15,335,942.44
其中：基金申购款	71,691,071.37	69,002,948.59	140,694,019.96
基金赎回款	-67,901,502.54	-57,456,574.98	-125,358,077.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,297,291.90	39,999,089.56	100,296,381.46

## 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	323,415.65	545,578.09
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	20,299.22	5,966.48
其他	7,886.33	2,374.08
合计	351,601.20	553,918.65

## 7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 20 日（基金合
----	--	--------------------------------

	月 31 日	同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	569,284,884.22	398,316,296.97
减：卖出股票成本总额	533,535,291.80	372,156,450.75
买卖股票差价收入	35,749,592.42	26,159,846.22

## 7.4.7.13 基金投资收益

无。

## 7.4.7.14 债券投资收益

无。

## 7.4.7.15 资产支持证券投资收益

无。

## 7.4.7.16 衍生工具收益

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20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,800,789.59	799,201.78
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,800,789.59	799,201.78

## 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20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1.交易性金融资产	15,721,234.58	11,507,572.49
——股票投资	15,721,234.58	11,507,572.49
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	15,721,234.58	11,507,572.49

## 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20日（基金合同生效日）至2016年12月31日
基金赎回费收入	1,134,620.49	1,556,913.06
合计	1,134,620.49	1,556,913.06

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20日（基金合同生效日）至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,841,511.56	1,286,260.59
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,841,511.56	1,286,260.59

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20日（基金合同生效日）至2016年12月31日
审计费用	70,000.00	60,000.00
信息披露费	80,000.00	75,000.00
银行费用	11,666.24	10,820.37
其他	400.00	-
合计	162,066.24	145,820.37

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
摩根大通银行	基金境外资产托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	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
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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
山东省农村经济开发投资公司	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20日（基金合同生效日） 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	308,061,894.83	26.46%	164,381,567.46	17.31%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 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	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	244,824.24	28.17%	16,015.56	27.29%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月20日（基金合同生效日）至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	153,087.80	20.97%	43,060.04	26.54%

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20日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,172,697.59	3,656,054.45
其中：支付销售机构的客户维护费	1,244,950.77	712,639.82

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 1.8%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×1.8%/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20日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,394,691.14	710,899.31

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 0.35%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×0.35%/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20日（基金合同生效日）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	20,524,363.98	323,415.65	14,570,632.72	545,578.09
摩根大通银行活期存款	21,416,620.38	-	8,140,098.71	-

注：本基金的活期银行存款分别由基金托管人中国建设银行和基金境外资产托管人摩根大通银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 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

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 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	-
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	-

##### 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(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	1,149,933	30,902,923.65	27,184,416.12	-
000820	神雾节能	2017-07-17	重大事项	26.83	2018-01-17	26.06	600,000	17,747,062.64	16,098,000.00	-
300109	新开源	2017-03-27	重大事项	42.49	2018-01-12	48.88	100,000	4,655,868.00	4,249,000.00	-
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	-

##### 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

无。

#### 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、银行间市场或场外市场交易，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全球证券市场中具有良好流动性的金融工具。本基金投资海外国家/地区的资本市场规模较大、金融市场发展程度高，投资的证券品种成交活跃。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。截至本期末，本基金未持有债券资产，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。

##### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控，并适时通过外汇远期投资交易对上述外汇风险进行管理。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	10,555.80	21,406,107.30	-	21,416,663.10
交易性金融资产	7,210,829.48	128,718,295.15	-	135,929,124.63
衍生金融资产	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	748.98	-	748.98
其他资产	-	-	-	-
资产合计	7,221,385.28	150,125,151.43	-	157,346,536.71
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	11,206.51	8,128,926.72	-	8,140,133.23
交易性金融资产	3,898,483.01	61,849,319.61	-	65,747,802.62
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	3,909,689.52	69,978,246.33	-	73,887,935.85
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

## 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
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
	所有外币相对人民币升值 5%	7,867,326.84	3,694,396.79
所有外币相对人民币贬值 5%	-7,867,326.84	-3,694,396.79	

## 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	272,260,744.25	85.37	192,627,239.15	89.66
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
合计	272,260,744.25	85.37	192,627,239.15	89.66

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、综合考虑组合持仓的特点和市场相关性，估测组合市场价格风险的数据为富时中国 A 股全股指数变动时，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、假定富时中国 A 股全股指数变化 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%	16,542,562.82	9,246,107.48
	-5%	-16,542,562.82	-9,246,107.48

#### 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 224,729,328.13 元，第二层次的余额为 47,531,416.12 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 192,627,239.15 元，第二层次的余额为 0 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	272,260,744.25	84.74
	其中：普通股	265,049,914.77	82.49
	存托凭证	7,210,829.48	2.24
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	48,346,885.69	15.05
8	其他各项资产	694,023.38	0.22
9	合计	321,301,653.32	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 31,856,429.79 元，占基金资产净值比例为 9.99%。

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国内地	136,331,619.62	42.75
中国香港	128,718,295.15	40.36
美国	7,210,829.48	2.26
合计	272,260,744.25	85.37

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
工业	74,804,589.07	23.45
信息技术	52,266,999.82	16.39
必需消费品	47,639,857.47	14.94
金融	34,743,128.90	10.89
非必需消费品	25,229,359.97	7.91
材料	12,708,748.15	3.98
公用事业	12,347,646.85	3.87
房地产	9,128,137.20	2.86
保健	3,392,276.82	1.06
能源	-	-
电信服务	-	-
合计	272,260,744.25	85.37

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	SHENW U	神雾环保	300156	深圳	中国内地	1,149,933.00	27,184,416.12	8.52

	ENVIRO NMENTA L TECHNO LOGY CO LTD							
2	DALIAN ZHIYUN AUTOMA TION CO LTD	智云股份	300097	深圳	中国内地	903,678.00	25,664,455.20	8.05
3	CHINA TAIPING INSURA NCE HOLDIN GS CO LTD	中国太平 保险控股 有限公司	00966	香港	中国香港	800,000.00	19,593,730.40	6.14
4	SHENW U ENERGY SAVING CO LTD	神雾节能	000820	深圳	中国内地	600,000.00	16,098,000.00	5.05
5	WULIAN GYE YIBIN CO LTD	五粮液	000858	深圳	中国内地	200,000.00	15,976,000.00	5.01
6	ZHOU HEI YA INTERN ATIONA L HOLDIN GS CO LTD	周黑鸭国 际控股有 限公司	01458	香港	中国香港	2,197,000.00	15,059,253.01	4.72
7	CHINA YUHUA EDUCAT ION CORP LTD	中国宇华 教育集团 有限公司	06169	香港	中国香港	4,000,000.00	13,107,068.80	4.11
8	HUANEN G POWER	华能国际 电力股份 有限公司	00902	香港	中国香港	3,000,000.00	12,287,877.00	3.85

	INTERNATIONAL INC							
9	XIAMEN FARATR ONIC CO LTD	法拉电子	600563	上海	中国内地	226,351.00	11,500,894.31	3.61
10	SEMICO DUCTO R MANUFA CTURIN G INTERN ATIONA L CORP	中芯国际 集成电路 制造有限 公司	00981	香港	中国香港	1,000,000.00	11,301,503.20	3.54
11	NEW CHINA LIFE INSURA NCE CO LTD	新华人寿 保险股份 有限公司	01336	香港	中国香港	250,000.00	11,159,398.50	3.50
12	TRAVEL SKY TECHNO LOGY LTD	中国民航 信息网络 股份有限 公司	00696	香港	中国香港	561,000.00	10,996,772.21	3.45
13	CHINA VANKE CO LTD	万科企业 股份有限 公司	02202	香港	中国香港	350,000.00	9,128,137.20	2.86
14	NINE DRAGO NS PAPER HOLDIN GS LTD	玖龙纸业 (控股)有 限公司	02689	香港	中国香港	800,000.00	8,372,474.56	2.63
15	OPPLE LIGHTIN G CO LTD	欧普照明	603515	上海	中国内地	178,400.00	7,642,656.00	2.40
16	ALIBAB A GROUP HOLDIN	-	BABA	纽约	美国	6,400.00	7,210,829.48	2.26

	G LTD							
17	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	泸州老窖	000568	深圳	中国内地	100,000.00	6,600,000.00	2.07
18	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	广汇宝信 汽车集团 有限公司	01293	香港	中国香港	2,000,000.00	6,536,816.20	2.05
19	SUZHOU ANJIE TECHNO LOGY CO LTD	安洁科技	002635	深圳	中国内地	219,200.00	5,718,928.00	1.79
20	KINGDE E INTERN ATIONA L SOFTWA RE GROUP CO LTD	金蝶国际 软件集团 有限公司	00268	香港	中国香港	1,500,000.00	5,517,006.00	1.73
21	OPPEIN HOME GROUP INC	欧派家居	603833	上海	中国内地	45,800.00	5,406,690.00	1.70
22	BOAI NKY PHARM ACEUTI CALS LTD	新开源	300109	深圳	中国内地	100,000.00	4,249,000.00	1.33
23	PING AN BANK CO LTD	平安银行	000001	深圳	中国内地	300,000.00	3,990,000.00	1.25
24	NINESTA R CORP	纳思达	002180	深圳	中国内地	120,800.00	3,299,048.00	1.03
25	CSPC PHARM ACEUTI CAL GROUP LTD	石药集团 有限公司	01093	香港	中国香港	250,000.00	3,297,664.95	1.03

26	SICHUAN SPIRITS CO LTD	舍得酒业	600702	上海	中国内地	50,000.00	2,333,000.00	0.73
27	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	瑞声科技控股有限公司	02018	香港	中国香港	20,000.00	2,330,517.08	0.73
28	HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	德赛西威	002920	深圳	中国内地	4,569.00	178,784.97	0.06
29	MONALISA GROUP CO LTD	蒙娜丽莎	002918	深圳	中国内地	1,512.00	84,218.40	0.03
30	FOSHAN GAS GROUP CO LTD	佛燃股份	002911	深圳	中国内地	2,195.00	59,769.85	0.02
31	YIPINHO NG PHARMACEUTICAL CO LTD	一品红	300723	深圳	中国内地	1,561.00	56,008.68	0.02
32	DBG TECHNOLOGY CO LTD	光弘科技	300735	深圳	中国内地	3,764.00	54,163.96	0.02
33	ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS CORP LTD	宏达电子	300726	深圳	中国内地	1,548.00	44,737.20	0.01
34	PENYAO ENVIRONMENTAL	鹏鹞环保	300664	深圳	中国内地	3,640.00	32,323.20	0.01

	L PROTEC TION CO LTD							
35	HUABA O INTERN ATIONA L HOLDIN GS LTD	华宝国际 控股有限 公司	00336	香港	中国香港	7,000.00	30,076.04	0.01
36	MINGCH EN HEALTH CO LTD	名臣健康	002919	深圳	中国内地	821.00	28,948.46	0.01
37	NINGBO RUNHE HIGH-TE CH MATERI ALS CO LTD	润禾材料	300727	深圳	中国内地	870.00	28,701.30	0.01
38	JIANGSU YIDA CHEMIC AL CO LTD	怡达股份	300721	深圳	中国内地	745.00	28,496.25	0.01
39	SHAANX I PANLON G PHARM ACEUTI CAL GROUP LTD BY SHARE LTD	盘龙药业	002864	深圳	中国内地	781.00	22,375.65	0.01
40	EAGLER ISE ELECTRI C & ELECTR ONIC	伊戈尔	002922	深圳	中国内地	1,245.00	22,248.15	0.01

	CHINA CO LTD							
41	ZHUHAI RUNDU PHARM ACEUTI CAL CO LTD	润都股份	002923	深圳	中国内地	954.00	16,227.54	0.01
42	JONES TECH PLC	中石科技	300684	深圳	中国内地	827.00	11,528.38	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	01458	25,347,653.08	11.80
2	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	02689	21,806,731.92	10.15
3	SHENWU ENVIRONMENTAL TECHNOLOGY CO LTD	300156	21,526,376.00	10.02
4	WULIANGYE YIBIN CO LTD	000858	19,289,675.66	8.98
5	XIAMEN FARATRONIC CO LTD	600563	18,621,847.86	8.67
6	KANGDE XIN COMPOSITE MATERIAL GROUP CO LTD	002450	18,341,290.02	8.54
7	TOP RESOURCE CONSERVATION & ENVIRONMENT CORP	300332	17,008,305.74	7.92
8	SUZHOU ANJIE TECHNOLOGY CO LTD	002635	16,444,143.91	7.65
9	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	01336	15,427,539.62	7.18
10	DALIAN ZHIYUN AUTOMATION CO LTD	300097	15,378,748.12	7.16

11	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	00874	15,325,717.30	7.13
12	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	00966	15,195,339.33	7.07
13	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	000568	14,750,260.75	6.87
14	CHONGQING THREE GORGES WATER CONSERVANCY & ELECTRIC POWER CO LTD	600116	14,267,954.36	6.64
15	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LTD	00522	13,787,232.86	6.42
16	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	000596	13,760,238.38	6.40
17	HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	00902	13,649,517.77	6.35
18	FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	01030	13,204,354.27	6.15
19	GUANGZHOU HANGXIN AVIATION TECHNOLOGY CO LTD	300424	12,883,374.24	6.00
20	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	02018	11,532,847.60	5.37
21	TCL MULTIMEDIA TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	01070	11,120,405.86	5.18
22	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	01055	10,205,025.75	4.75
23	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	06169	9,383,893.67	4.37
24	JU TENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	03336	9,002,012.62	4.19
25	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD	00696	8,997,423.35	4.19
26	CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	01800	8,917,658.06	4.15

27	CHINA VANKE CO LTD	02202	8,654,738.77	4.03
28	SHENWU ENERGY SAVING CO LTD	000820	8,599,212.64	4.00
29	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD	00688	8,487,165.01	3.95
30	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	01186	8,189,939.61	3.81
31	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL CORP	00981	7,563,509.46	3.52
32	CHINA EVERGRANDE GROUP	03333	7,248,085.59	3.37
33	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	01293	6,921,775.84	3.22
34	SHENZHEN LIANDE AUTOMATIC EQUIPMENT CO LTD	300545	6,822,127.00	3.18
35	LINGYUAN IRON & STEEL CO LTD	600231	6,786,387.66	3.16
36	BEIJING SPC ENVIRONMENT PROTECTION TECH CO LTD	002573	6,593,152.00	3.07
37	NUODE INVESTMENT CO LTD	600110	6,489,415.00	3.02
38	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	601155	6,423,886.89	2.99
39	SINOTRANS SHIPPING LTD	00368	6,378,326.49	2.97
40	HUATAI SECURITIES CO LTD	601688	6,138,998.02	2.86
41	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	002050	6,041,954.38	2.81
42	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	02382	5,988,188.59	2.79
43	AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	002013	5,735,776.86	2.67
44	BEIJING WKW AUTOMOTIVE PARTS	002662	5,597,389.70	2.61

	CO LTD			
45	ZHEJIANG FOUNDER MOTOR CO LTD	002196	5,172,607.12	2.41
46	BLACKCOW FOOD CO LTD	002387	5,032,596.10	2.34
47	OPPEIN HOME GROUP INC	603833	4,713,927.36	2.19
48	BOAI NKY PHARMACEUTICALS LTD	300109	4,655,868.00	2.17
49	PING AN BANK CO LTD	000001	4,492,428.41	2.09
50	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	600848	4,300,670.00	2.00

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。

#### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	KANGDE XIN COMPOSITE MATERIAL GROUP CO LTD	002450	31,724,656.23	14.77
2	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	02689	17,243,323.75	8.03
3	FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	01030	16,481,874.99	7.67
4	WULIANGYE YIBIN CO LTD	000858	15,543,846.00	7.23
5	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LTD	00522	15,341,274.07	7.14
6	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	00874	13,961,037.24	6.50
7	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	000568	13,120,798.97	6.11
8	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	000596	12,691,836.47	5.91
9	TOP RESOURCE CONSERVATION & ENVIRONMENT CORP	300332	12,383,805.00	5.76
10	CHONGQING THREE GORGES WATER CONSERVANCY & ELECTRIC POWER CO LTD	600116	11,858,336.00	5.52
11	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	02018	11,702,346.68	5.45
12	SUZHOU ANJIE TECHNOLOGY CO LTD	002635	11,578,056.78	5.39
13	XIAMEN FARATRONIC CO LTD	600563	11,530,341.00	5.37
14	FUFENG GROUP LTD	00546	10,592,231.75	4.93
15	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	01458	9,769,468.81	4.55
16	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	02238	9,604,113.48	4.47
17	TCL MULTIMEDIA TECHNOLOGY HOLDINGS	01070	9,424,223.32	4.39

	LTD			
18	GUANGZHOU HANGXIN AVIATION TECHNOLOGY CO LTD	300424	9,273,788.52	4.32
19	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	01055	9,255,473.99	4.31
20	DALIAN ZHIYUN AUTOMATION CO LTD	300097	9,048,542.30	4.21
21	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	002050	8,872,019.04	4.13
22	CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	01800	8,570,436.21	3.99
23	BLACKCOW FOOD CO LTD	002387	8,488,839.42	3.95
24	JU TENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	03336	8,476,953.15	3.95
25	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	02382	7,987,626.71	3.72
26	SHENZHEN LIANDE AUTOMATIC EQUIPMENT CO LTD	300545	7,962,719.92	3.71
27	CHINA EVERGRANDE GROUP	03333	7,620,489.12	3.55
28	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	01186	7,522,048.73	3.50
29	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD	0688	7,318,406.26	3.41
30	BEIJING SPC ENVIRONMENT PROTECTION TECH CO LTD	002573	7,158,059.78	3.33
31	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	00175	7,155,457.24	3.33
32	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	01093	7,034,707.58	3.27
33	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	601155	6,901,905.10	3.21
34	XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	02208	3,494,687.56	1.63
		002202	3,295,179.62	1.53
35	LINGYUAN IRON & STEEL CO LTD	600231	6,779,604.00	3.16
36	SHAANXI CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	600984	6,240,777.00	2.90
37	WH GROUP LTD	00288	6,239,037.37	2.90
38	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	01336	6,173,017.80	2.87
39	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	01293	5,949,256.01	2.77
40	ZHEJIANG FOUNDER MOTOR CO LTD	002196	5,886,248.60	2.74
41	SINOTRANS SHIPPING LTD	00368	5,852,410.68	2.72
42	DEHUA TB NEW DECORATION MATERIALS CO LTD	002043	5,734,883.70	2.67
43	BEIJING WKW AUTOMOTIVE PARTS CO LTD	002662	5,608,909.93	2.61
44	HUATAI SECURITIES CO LTD	601688	5,460,489.77	2.54
45	SHENZHEN YINGHE TECHNOLOGY CO LTD	300457	5,304,796.00	2.47
46	NUODE INVESTMENT CO LTD	600110	5,152,915.00	2.40
47	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND CABLE JOINT STOCK LTD CO	06869	5,148,518.96	2.40
48	AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	002013	4,882,584.50	2.27

49	SHANGHAI HIGHLY GROUP CO LTD	600619	4,748,249.44	2.21
50	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD	00696	4,564,305.61	2.12
51	XINYU IRON & STEEL CO LTD	600782	4,440,252.00	2.07
52	CHONGQING FULING ELECTRIC POWER INDUSTRIAL CO LTD	600452	4,338,894.00	2.02
53	BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	002153	4,328,185.87	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。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	597,447,562.32
卖出收入（成交）总额	569,284,884.22

注：“买入成本”、“卖出收入”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。

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 8.11 投资组合报告附注

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

8.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 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	181,155.82
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	200,748.98
4	应收利息	6,126.95
5	应收申购款	305,991.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	694,023.38

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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
9,546	22,903.38	4,312,579.89	1.97%	214,323,067.30	98.03%

### 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	2,273,879.43	1.04%

### 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年1月20日)基金份额总额	430,488,511.77
本报告期期初基金份额总额	174,602,561.45
本报告期基金总申购份额	359,017,701.86
减：本报告期基金总赎回份额	314,984,616.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	218,635,647.19

## §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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 70,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 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	

方正证券	1	388,251,054.30	33.34%	180,609.92	20.78%	-
中信证券	2	308,061,894.83	26.46%	244,824.24	28.17%	-
CICC	-	123,042,344.95	10.57%	153,802.98	17.70%	-
BOCI SECURITIES	-	97,659,966.22	8.39%	146,489.97	16.86%	-
CREDIT SUISSE	-	65,869,176.15	5.66%	19,760.75	2.27%	-
西南证券	2	47,537,563.67	4.08%	44,271.81	5.09%	-
MORGAN STANLEY	-	41,318,724.89	3.55%	14,507.81	1.67%	-
广发证券	1	31,633,126.03	2.72%	29,459.86	3.39%	-
天风证券	2	28,993,336.61	2.49%	10,122.99	1.16%	-
爱建证券	1	22,783,792.55	1.96%	16,661.81	1.92%	-
中国银河证券	1	9,202,685.64	0.79%	8,570.21	0.99%	-

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，本基金还选择了安信证券、财富里昂证券、高华证券、广州证券、国联证券、国泰君安证券、国信证券、华宝证券、华福证券、华融证券、华鑫证券、上海证券、申万宏源证券、太平洋证券、信达证券、西部证券、兴业证券、中信建投证券、中金公司、中投证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，天风证券、中信证券、华宝证券、国信证券的交易单元为本基金本期新增的券商交易单元。中投证券的交易单元为本期剔除的券商交易单元。

⑤此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金

等交易而合计支付该券商的佣金合计。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-
BOCI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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	关于华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）境外主要投资场所 2017 年节假日暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	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、赎回等业务数量限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-16
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
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
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式	中国证监会指定报刊及	2017-04-07

	基金新增中银国际证券有限责任公司为代销机构的公告	网站	
8	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国工商银行、中国农业银行开通申购、赎回等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-10
9	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
10	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
11	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
12	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
13	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增江苏银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-07-28
14	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在华泰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	2017-08-01
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
16	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增世纪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	2017-09-22
17	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
18	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
19	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的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-11-07
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
21	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

## §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 中国证监会准予基金注册的文件；

13.1.2 《华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》；

13.1.3 《华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）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