

# 华夏成长证券投资基金

## 2018 年半年度报告

### 2018 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十五日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	9
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	28
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	34
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	34
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	34
7.12 投资组合报告附注.....	34
§8 基金份额持有人信息.....	35
§9 开放式基金份额变动.....	36
§10 重大事件揭示.....	36
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	39
§12 备查文件目录.....	39

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏成长证券投资基金	
基金简称	华夏成长混合	
基金主代码	000001	
交易代码	000001	000002
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2001 年 12 月 18 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,283,979,296.50 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-634,143.16
本期利润	-380,346,324.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0881
本期加权平均净值利润率	-7.90%
本期基金份额净值增长率	-7.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	190,858,120.92
期末可供分配基金份额利润	0.0446
期末基金资产净值	4,474,837,417.42
期末基金份额净值	1.045
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	497.00%

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
过去一个月	-5.60%	1.23%	-	-	-	-
过去三个月	-5.52%	1.10%	-	-	-	-
过去六个月	-7.85%	1.14%	-	-	-	-
过去一年	-2.59%	0.96%	-	-	-	-
过去三年	-27.73%	1.24%	-	-	-	-
自基金合同生	497.00%	1.25%	-	-	-	-

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

注：本基金未规定业绩比较基准。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 华夏成长证券投资基金

#### 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2001 年 12 月 18 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：本基金未规定业绩比较基准。

## §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 2018 年 6 月 30 日数据），华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 3/154；华夏医疗健康混合（A 类）在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（A 类）”中排序 2/152；华夏医药 ETF、华夏消费 ETF、华夏沪港通恒生 ETF 在“股票基金-指数股票型基金-股票 ETF 基金”中分别排序 2/115、8/115、9/115。

上半年，公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在《中国证券报》评奖活动中，公司荣获“中国基金业 20 周年卓越贡献公司”和“被动投资金牛基金公司”两大奖项，旗下华夏回报混合荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”称号，华夏安康债券荣获“2017 年度开放式债券型金牛基金”称号。在《证券时报》评奖活动中，旗下华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。在《上海证券报》举行的 2018 中国基金业峰会暨第十五届“金基金”颁奖评选中，华夏基金荣获公募基金 20 周年“金基金”TOP 基金公司大奖、华夏沪深 300ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（一年期）、华夏上证 50ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（三年期）。在《证券时报》的评奖活动中，华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。

在客户服务方面，2018 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金电子交易平台开展华夏财富宝货币 A、华夏薪金宝货币转换业务优惠活动，为客户提供了更便捷和优惠的基金投资方式；（2）微信服务号上线随存随取业务实时通知功能，方便客户及时了解交易变动的情况；华夏基金网上交易平台上线手机号码登录功能，为客户登录网上交易平台提供了更便捷的方式；（3）与中原银行、长城华西银行、西安银行等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“四大明星基金有奖寻人”、“华夏基金 20 周年司庆感恩二十年”、“华夏基金 20 周年献礼，华夏基金户口本”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）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
董阳阳	本基金的基金	2015-01-0	-	10 年	美国波士顿学院金融学硕士、

	经理、股票投资部执行总经理	7			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，华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2013 年 3 月 11 日至 2017 年 2 月 24 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 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，全球延续复苏态势，但地缘政治矛盾渐起，替代全球经济增长问题，成为全球市场核心焦点。财政刺激带动美国经济进入扩张区间，反观欧洲经济，表现相对疲软，退出宽松政策预期难见落地。更为关键的是，围绕中美、美欧多国间贸易摩擦一波三折，由此可能产生的诸多不确定性后果，引发全球市场重点关注。

在不确定性丛生的海外环境下，上半年，酝酿已久的去杠杆政策初现端倪，财政支出增速相对



偏弱，国内经济初现了小幅减速迹象。尽管地产销售有所回升，PPI 环比历经年初以来持续下跌后，于 2 季度触底反弹。货币政策与财政政策之间的博弈，成为目前阶段左右中国经济走势的重点。基于社会融资总量的一度走低，与信用违约事件的集中爆发，央行通过定向降准、扩大 MLF 抵押品范围等，力求传递平稳去杠杆信号。在全球央行逐步转向紧缩环境下，汇率成为应对工具，人民币在上半年走出一轮先涨后跌的 U 型走势。

在内外经济走势与政策角力的不确定性下，上半年以来各项指数取得负收益，大部分行业板块皆走低，市场在 2017 年精选白马龙头的策略基础上，进一步细化筛选行业，在更严苛的选股标准下，稳健成长的白酒、医药成为市场集中配置的主力板块，而与经济相对强相关的金融、周期等板块跌幅较深。

报告期内，本基金维持对白酒板块高配置，经历了 1 季度的较大回撤并于 2 季度获得了显著的超额收益，同时，“自下而上”阶段性选择了医药、电子、新能源、电商等板块的优质成长股，进行集中投资，取得较好效果。2 季度，本基金增加了对保险和航空行业的配置比重，但表现不佳，拖累了组合净值的整体表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.045 元，本报告期份额净值增长率为-7.85%，同期上证综指下跌 13.90%，深证成指下跌 15.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，货币政策与财政政策之间的角力，将影响经济运行的趋势与效率。去杠杆政策下，资管新规对基建和地产的融资产生了较大的负面影响，叠加贸易战带来的不确定性，经济整体承压，后续政策组合能否有助于扭转经济主体预期，是下半年关注的核心问题。另一方面，地缘政治仍是下半年策略抉择中的重点考虑因素，中美贸易摩擦走向与结构性影响需要进一步判断。但再观指数，整体的估值已经回落至 2014 年以来的最低水平，继续大幅下跌的概率也不大。在宽货币、紧信用的流动性格局下，确定性成长股的机会将较为明显，其余板块和风格均将处于寻底的状态。本基金将择机均衡板块的配置，花更多的精力在“自下而上”的成长股研究和选择上。

投资策略方面，一方面，我们将采取“自下而上”的选股原则，提高甄选标准，去伪存真，努力寻找真成长股并长期持有；另一方面，我们将继续关注宏观经济和政策的走向，寻找市场的预期差，关注由此带来的潜在投资机会或风险。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华夏成长证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	79,657,293.01	290,071,394.71
结算备付金		295,152,538.26	15,704,678.57
存出保证金		1,745,798.03	1,631,626.85
交易性金融资产	6.4.7.2	4,192,260,356.55	4,715,051,268.05
其中：股票投资		3,242,083,880.36	3,635,405,254.65
基金投资		-	-
债券投资		950,176,476.19	1,079,646,013.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	160,983,341.48
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	14,106,602.48	22,675,324.90
应收股利		-	-
应收申购款		3,346,189.27	3,543,233.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,586,268,777.60	5,209,660,867.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	110,000,000.00
应付证券清算款		70,067,023.20	60,722,760.01
应付赎回款		5,421,511.38	6,645,849.68
应付管理人报酬		5,753,143.83	6,338,281.06
应付托管费		958,857.31	1,056,380.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	25,918,112.75	33,180,438.43
应交税费		2,874,055.70	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	6.4.7.8	438,656.01	375,042.96
负债合计		111,431,360.18	221,212,539.97
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	4,283,979,296.50	4,398,316,713.21
未分配利润	6.4.7.10	190,858,120.92	590,131,614.52
所有者权益合计		4,474,837,417.42	4,988,448,327.73
负债和所有者权益总计		4,586,268,777.60	5,209,660,867.70

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.045 元，基金份额总额 4,283,979,296.50 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏成长证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-321,298,190.23	577,440,381.74
1.利息收入		25,381,324.81	28,930,995.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,211,860.55	2,167,275.58
债券利息收入		24,020,601.00	25,685,524.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		148,863.26	1,078,195.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		32,291,617.96	134,709,312.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,372,999.46	105,427,706.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	608,969.03	-424,753.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	14,309,649.47	29,706,360.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-379,712,181.54	413,183,318.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	741,048.54	616,755.54
<b>减：二、费用</b>		59,048,134.47	69,626,176.17
1.管理人报酬		35,750,508.19	36,484,175.02
2.托管费		5,958,418.04	6,080,695.83
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	16,538,722.15	24,500,532.88
5.利息支出		557,142.23	2,351,231.39

其中：卖出回购金融资产支出		557,142.23	2,351,231.39
6.税金及附加		38,595.13	-
7.其他费用	6.4.7.21	204,748.73	209,541.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-380,346,324.70	507,814,205.57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-380,346,324.70	507,814,205.57

6.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,398,316,713.21	590,131,614.52	4,988,448,327.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-380,346,324.70	-380,346,324.70
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）	-114,337,416.71	-18,927,168.90	-133,264,585.61
其中：1.基金申购款	378,684,085.76	42,638,861.68	421,322,947.44
2.基金赎回款	-493,021,502.47	-61,566,030.58	-554,587,533.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,283,979,296.50	190,858,120.92	4,474,837,417.42
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,541,678,483.82	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）	-	507,814,205.57	507,814,205.57
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）	-100,953,626.49	-12,494,917.76	-113,448,544.25
其中：1.基金申购款	349,905,479.90	30,001,819.13	379,907,299.03

2.基金赎回款	-450,859,106.39	-42,496,736.89	-493,355,843.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,440,724,857.33	668,245,375.79	5,108,970,233.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华夏成长证券投资基金（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%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财税[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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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增值税征收范围，不征收增值税。
- 2、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。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。
- 3、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- 4、存款利息收入不征收增值税。

5、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。

6、资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

7、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。

8、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。

9、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。

10、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。

11、本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	79,657,293.01
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	79,657,293.01

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,353,003,536.91	3,242,083,880.36	-110,919,656.55



贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	91,160,784.94	91,742,476.19
	银行间市场	861,810,049.33	858,434,000.00
	合计	952,970,834.27	950,176,476.19
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,305,974,371.18	4,192,260,356.55	-113,714,014.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	49,440.60
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	28,418.70
应收债券利息	14,027,957.58
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	785.60
合计	14,106,602.48

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日

交易所市场应付交易费用	25,914,062.75
银行间市场应付交易费用	4,050.00
合计	25,918,112.75

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	20,052.70
预提费用	168,603.31
合计	438,656.01

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,398,316,713.21	4,398,316,713.21
本期申购	378,684,085.76	378,684,085.76
本期赎回（以“-”号填列）	-493,021,502.47	-493,021,502.47
本期末	4,283,979,296.50	4,283,979,296.50

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,274,942,361.60	-684,810,747.08	590,131,614.52
本期利润	-634,143.16	-379,712,181.54	-380,346,324.70
本期基金份额交易产生的变动数	-33,230,285.67	14,303,116.77	-18,927,168.90
其中：基金申购款	109,210,003.75	-66,571,142.07	42,638,861.68
基金赎回款	-142,440,289.42	80,874,258.84	-61,566,030.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,241,077,932.77	-1,050,219,811.85	190,858,120.92

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,069,659.60
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	127,954.76

其他	14,246.19
合计	1,211,860.55

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	6,107,727,486.08
减：卖出股票成本总额	6,090,354,486.62
买卖股票差价收入	17,372,999.46

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	676,082,087.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	658,138,308.20
减：应收利息总额	17,334,810.03
买卖债券差价收入	608,969.03

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,309,649.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,309,649.47

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-379,712,181.54
——股票投资	-387,531,082.53
——债券投资	7,818,900.99
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-379,712,181.54

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	741,032.74
其他	15.80
合计	741,048.54

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	16,534,897.15
银行间市场交易费用	3,825.00
交易基金产生的费用	-

其中：申购费	-
赎回费	-
合计	16,538,722.15

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	119,014.74
银行费用	17,545.42
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	204,748.73

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

中信证券	1,417,191,334.64	11.63%	8,048,078,724.78	46.05%
------	------------------	--------	------------------	--------

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	-	-	2,650,000,000.00	32.09%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	1,166,299.15	12.48%	957,614.17	3.70%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	6,209,462.39	44.06%	3,975,659.11	12.46%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	35,750,508.19	36,484,175.02
其中：支付销售机构的客户维护费	4,646,539.80	4,634,894.65

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,958,418.04	6,080,695.83

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	79,657,293.01	1,069,659.60	68,562,090.26	1,864,550.41

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

## 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

## 6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新发流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300740	御家汇	2018-06-19	重大事项	28.76	-	-	554,947	16,519,855.09	15,960,275.72	-
603939	益丰药房	2018-04-17	重大事项	59.72	2018-07-16	65.69	100,000	4,639,810.84	5,972,000.00	-
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大事项	18.08	-	-	42,050	951,116.97	760,264.00	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项	15.27	-	-	12,408	212,778.84	189,470.16	-
600217	中再资环	2018-03-29	重大事项	4.81	-	-	600	5,046.61	2,886.00	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购



无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	79,657,293.01	-	-	79,657,293.01
结算备付金	295,152,538.26	-	-	295,152,538.26
结算保证金	1,745,798.03	-	-	1,745,798.03
债券投资	692,647,476.19	120,575,000.00	136,954,000.00	950,176,476.19
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	61,901.66	-	-	61,901.66
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 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

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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利率敏感性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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-2,420,809.43	-3,490,198.66
	利率下降 25 个基点	2,441,300.61	3,524,261.49

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	3,242,083,880.36	72.45	3,635,405,254.65	72.88
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	3,242,083,880.36	72.45	3,635,405,254.65	72.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	+5%	170,197,083.80	237,282,900.97
	-5%	-170,197,083.80	-237,282,900.97

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

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

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2018 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 3,227,188,194.23 元，第二层次的余额为 965,072,162.32 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2017 年 12 月 31 日止：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。）

6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，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。

6.4.14.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,242,083,880.36	70.69
	其中：股票	3,242,083,880.36	70.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	950,176,476.19	20.72
	其中：债券	950,176,476.19	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	-	-
	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	374,809,831.27	8.17
8	其他各项资产	19,198,589.78	0.42
9	合计	4,586,268,777.60	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,777,585,831.60	39.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,082.07	0.00
E	建筑业	9,043,589.77	0.20
F	批发和零售业	157,823,716.55	3.53
G	交通运输、仓储和邮政业	253,396,852.44	5.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	310,288,402.05	6.93
J	金融业	365,160,786.59	8.16
K	房地产业	87,327,465.65	1.95
L	租赁和商务服务业	211,612,839.93	4.73
M	科学研究和技术服务业	42,224,714.14	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	11,223,027.13	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	16,287,572.44	0.36
S	综合	-	-
	合计	3,242,083,880.36	72.45

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000568	泸州老窖	5,045,042	307,041,256.12	6.86
2	601336	新华保险	4,880,164	209,261,432.32	4.68
3	002127	南极电商	21,769,227	204,413,041.53	4.57
4	300309	吉艾科技	9,698,766	196,690,974.48	4.40
5	002195	二三四五	43,560,100	186,437,228.00	4.17
6	000858	五粮液	2,287,429	173,844,604.00	3.88
7	002202	金风科技	13,049,139	164,941,116.96	3.69
8	601318	中国平安	2,206,840	129,276,687.20	2.89
9	600115	东方航空	16,283,150	107,794,453.00	2.41
10	600029	南方航空	12,169,300	102,830,585.00	2.30
11	600809	山西汾酒	1,390,250	87,432,822.50	1.95
12	600702	舍得酒业	2,251,670	81,262,770.30	1.82
13	600872	中炬高新	2,276,405	63,739,340.00	1.42
14	002867	周大生	1,932,970	60,869,225.30	1.36
15	000661	长春高新	257,400	58,609,980.00	1.31
16	600779	水井坊	1,004,900	55,500,627.00	1.24
17	600519	贵州茅台	75,600	55,298,376.00	1.24
18	600056	中国医药	3,000,010	54,810,182.70	1.22
19	600887	伊利股份	1,898,300	52,962,570.00	1.18
20	300413	快乐购	1,355,500	51,427,670.00	1.15
21	000002	万科 A	1,999,939	49,198,499.40	1.10
22	600673	东阳光科	4,301,600	44,435,528.00	0.99
23	300584	海辰药业	1,065,350	43,519,547.50	0.97
24	603019	中科曙光	876,930	40,224,779.10	0.90
25	600622	光大嘉宝	5,133,375	36,908,966.25	0.82
26	600885	宏发股份	1,165,027	34,857,607.84	0.78
27	600062	华润双鹤	1,403,477	34,455,360.35	0.77
28	300404	博济医药	1,601,250	33,322,012.50	0.74
29	000333	美的集团	550,000	28,721,000.00	0.64
30	300454	深信服	260,677	28,664,042.92	0.64
31	300096	易联众	3,303,000	27,811,260.00	0.62
32	300059	东方财富	2,050,068	27,019,896.24	0.60
33	600570	恒生电子	418,715	22,170,959.25	0.50

34	002024	苏宁易购	1,499,964	21,119,493.12	0.47
35	002078	太阳纸业	2,100,000	20,349,000.00	0.45
36	300124	汇川技术	610,000	20,020,200.00	0.45
37	000963	华东医药	378,281	18,252,058.25	0.41
38	300418	昆仑万维	961,600	18,155,008.00	0.41
39	300192	科斯伍德	1,922,692	17,977,170.20	0.40
40	002035	华帝股份	699,989	17,100,731.27	0.38
41	300251	光线传媒	1,599,958	16,287,572.44	0.36
42	300740	御家汇	554,947	15,960,275.72	0.36
43	601021	春秋航空	430,000	15,062,900.00	0.34
44	300673	佩蒂股份	299,850	14,392,800.00	0.32
45	600176	中国巨石	1,364,900	13,962,927.00	0.31
46	603885	吉祥航空	846,800	13,049,188.00	0.29
47	603515	欧普照明	200,000	9,348,000.00	0.21
48	601111	中国国航	1,050,000	9,334,500.00	0.21
49	601688	华泰证券	600,021	8,982,314.37	0.20
50	600477	杭萧钢构	1,819,338	8,714,629.02	0.19
51	300284	苏交科	1,055,883	8,373,152.19	0.19
52	002203	海亮股份	999,942	8,099,530.20	0.18
53	601377	兴业证券	1,500,000	7,905,000.00	0.18
54	002707	众信旅游	749,979	7,199,798.40	0.16
55	603833	欧派家居	50,067	6,385,044.51	0.14
56	002669	康达新材	300,000	6,351,000.00	0.14
57	300258	精锻科技	451,200	6,204,000.00	0.14
58	603939	益丰药房	100,000	5,972,000.00	0.13
59	600717	天津港	700,000	5,271,000.00	0.12
60	000978	桂林旅游	868,100	5,147,833.00	0.12
61	601601	中国太保	153,512	4,889,357.20	0.11
62	002643	万润股份	635,600	4,747,932.00	0.11
63	600837	海通证券	500,000	4,735,000.00	0.11
64	600054	黄山旅游	329,264	3,835,925.60	0.09
65	600070	浙江富润	494,600	3,828,204.00	0.09
66	603899	晨光文具	118,806	3,764,962.14	0.08
67	002415	海康威视	100,000	3,713,000.00	0.08
68	000546	金圆股份	244,873	3,273,952.01	0.07
69	002444	巨星科技	199,100	2,192,091.00	0.05
70	601233	桐昆股份	100,097	1,723,670.34	0.04
71	002372	伟星新材	96,279	1,703,175.51	0.04
72	000888	峨眉山 A	180,200	1,583,958.00	0.04
73	603788	宁波高发	60,200	1,483,328.00	0.03
74	601689	拓普集团	75,725	1,472,094.00	0.03
75	603816	顾家家居	20,000	1,470,200.00	0.03
76	300567	精测电子	16,000	1,273,600.00	0.03

77	300661	圣邦股份	10,000	1,231,500.00	0.03
78	600048	保利地产	100,000	1,220,000.00	0.03
79	603686	龙马环卫	45,100	1,102,244.00	0.02
80	000786	北新建材	53,840	997,655.20	0.02
81	002050	三花智控	50,000	942,500.00	0.02
82	603579	荣泰健康	12,000	839,520.00	0.02
83	002507	涪陵榨菜	31,358	805,273.44	0.02
84	000666	经纬纺机	42,050	760,264.00	0.02
85	300750	宁德时代	10,261	738,381.56	0.02
86	002033	丽江旅游	90,139	655,310.53	0.01
87	600521	华海药业	24,000	640,560.00	0.01
88	300373	扬杰科技	20,000	572,000.00	0.01
89	002185	华天科技	100,000	564,000.00	0.01
90	601799	星宇股份	8,000	479,120.00	0.01
91	603259	药明康德	4,741	450,157.95	0.01
92	002583	海能达	50,000	417,500.00	0.01
93	002572	索菲亚	10,000	321,800.00	0.01
94	300308	中际旭创	5,054	303,442.16	0.01
95	600271	航天信息	10,000	252,700.00	0.01
96	600081	东风科技	20,000	202,000.00	0.00
97	300285	国瓷材料	10,000	199,400.00	0.00
98	002051	中工国际	12,408	189,470.16	0.00
99	600729	重庆百货	5,400	177,930.00	0.00
100	002659	凯文教育	10,057	139,490.59	0.00
101	002920	德赛西威	4,569	136,613.10	0.00
102	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.00
103	300463	迈克生物	4,915	122,530.95	0.00
104	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.00
105	603486	科沃斯	1,639	105,338.53	0.00
106	300741	华宝股份	2,625	104,422.50	0.00
107	603587	地素时尚	2,442	100,879.02	0.00
108	603013	亚普股份	2,573	83,313.74	0.00
109	300746	汉嘉设计	2,318	79,391.50	0.00
110	603348	文灿股份	2,011	74,246.12	0.00
111	000899	赣能股份	14,823	60,626.07	0.00
112	600787	中储股份	7,006	54,226.44	0.00
113	603596	伯特利	1,532	52,118.64	0.00
114	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
115	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
116	603045	福达合金	891	43,427.34	0.00
117	603680	今创集团	1,443	43,362.15	0.00
118	300033	同花顺	772	30,007.64	0.00
119	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00



120	601965	中国汽研	971	8,136.98	0.00
121	603233	大参林	78	5,339.88	0.00
122	600217	中再资环	600	2,886.00	0.00
123	600535	天士力	74	1,910.68	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601336	新华保险	491,349,772.10	9.85
2	600048	保利地产	307,583,361.15	6.17
3	601318	中国平安	228,974,701.54	4.59
4	002195	二三四五	228,171,882.29	4.57
5	600115	东方航空	192,688,153.22	3.86
6	000858	五粮液	188,500,163.71	3.78
7	600029	南方航空	180,783,342.60	3.62
8	001979	招商蛇口	164,873,760.66	3.31
9	603799	华友钴业	156,704,603.46	3.14
10	002202	金风科技	150,683,870.89	3.02
11	601601	中国太保	149,499,704.17	3.00
12	300309	吉艾科技	132,303,731.20	2.65
13	000661	长春高新	123,872,216.36	2.48
14	600703	三安光电	121,463,599.35	2.43
15	002127	南极电商	120,400,195.33	2.41
16	000977	浪潮信息	116,358,184.49	2.33
17	600570	恒生电子	109,553,083.01	2.20
18	600702	舍得酒业	105,401,444.17	2.11
19	601233	桐昆股份	103,335,420.93	2.07
20	000963	华东医药	99,143,236.36	1.99

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601336	新华保险	427,278,516.98	8.57
2	002236	大华股份	381,654,263.62	7.65
3	600048	保利地产	366,927,973.30	7.36
4	603799	华友钴业	293,350,117.82	5.88
5	000963	华东医药	211,609,606.05	4.24
6	000858	五粮液	199,031,217.66	3.99

7	001979	招商蛇口	172,563,909.83	3.46
8	601601	中国太保	146,828,942.20	2.94
9	601233	桐昆股份	126,444,230.04	2.53
10	002202	金风科技	119,983,924.08	2.41
11	000977	浪潮信息	116,199,637.10	2.33
12	600703	三安光电	116,160,196.08	2.33
13	300156	神雾环保	109,005,114.41	2.19
14	600056	中国医药	101,372,445.63	2.03
15	000002	万科 A	91,359,130.26	1.83
16	000661	长春高新	90,912,621.71	1.82
17	600027	华电国际	90,784,531.87	1.82
18	600779	水井坊	87,485,740.93	1.75
19	600535	天士力	87,051,506.32	1.75
20	600011	华能国际	85,913,520.68	1.72

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	6,084,564,194.86
卖出股票的收入（成交）总额	6,107,727,486.08

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	89,660,000.60	2.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	759,859,000.00	16.98
	其中：政策性金融债	759,859,000.00	16.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	99,590,000.00	2.23
7	可转债（可交换债）	1,067,475.59	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	950,176,476.19	21.23

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	180404	18 农发 04	2,600,000	260,780,000.00	5.83
2	180207	18 国开 07	1,000,000	99,930,000.00	2.23
3	101564021	15 华能集 MTN002	1,000,000	99,590,000.00	2.23
4	170410	17 农发 10	900,000	90,027,000.00	2.01
5	180407	18 农发 07	600,000	60,096,000.00	1.34

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,745,798.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,106,602.48
5	应收申购款	3,346,189.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,198,589.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128022	众信转债	634,234.73	0.01
2	128016	雨虹转债	433,240.86	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
235,114	18,220.86	11,787,146.09	0.28%	4,272,192,150.41	99.72%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	502,984.34	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	4,398,316,713.21
本报告期基金总申购份额	378,684,085.76
减：本报告期基金总赎回份额	493,021,502.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,283,979,296.50

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 4 月 28 日发布公告，杨明辉先生代任华夏基金管理有限公司总经理，汤晓东先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于 2018 年 5 月 19 日发布公告，李一梅女士担任华夏基金管理有限公司总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	1	3,842,477,333.17	31.52%	2,810,006.11	30.07%	-
光大证券	1	3,663,646,679.58	30.05%	2,679,213.00	28.67%	-
中信证券	2	1,417,191,334.64	11.63%	1,166,299.15	12.48%	-
申万宏源证券	1	961,570,419.38	7.89%	895,505.37	9.58%	-
东兴证券	1	713,943,459.57	5.86%	522,110.87	5.59%	-
安信证券	1	616,434,585.00	5.06%	450,800.56	4.82%	-
方正证券	1	408,019,374.43	3.35%	298,386.84	3.19%	-
万联证券	1	333,637,772.65	2.74%	310,716.49	3.32%	-
招商证券	1	209,718,893.22	1.72%	195,311.03	2.09%	-
万和证券	1	23,601,451.20	0.19%	17,259.89	0.18%	-
华泰证券	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，本基金还选择了东方证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、中信建投证券、平安证券、银河证券、广州证券、中金公司、西部证券、高华证券、东莞证券、国海证券、长江证券、长城证券、信达证券、华创证券、民族证券、国盛证券、民生证券、东吴证券、川财证券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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
天风证券	-	-	-	-
光大证券	12,693,715.39	8.25%	-	-
中信证券	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	450,000,000.00	100.00%
东兴证券	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-
华泰证券	141,228,599.17	91.75%	-	-

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于杭州分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-31
2	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增华瑞保险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	2018-03-01
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万家财富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	2018-03-13
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中原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	2018-03-19

5	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订旗下开放式基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-23
6	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对短期投资行为收取短期赎回费的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-23
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中民财富基金销售（上海）有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-23
8	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-28
9	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增和耕传承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	2018-05-09
10	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-19
11	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增西安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	2018-06-05
12	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在国金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	2018-06-07
13	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增凤凰金信（银川）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	2018-06-29

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

12.1.2 《华夏成长证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏成长证券投资基金托管协议》；

12.1.4 法律意见书；



12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇一八年八月二十五日