

华夏乐享健康灵活配置混合型

证券投资基金

2019 年半年度报告摘要

2019 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十九日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华夏乐享健康混合
基金主代码	002264
交易代码	002264
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 3 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	165,413,415.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	积极把握健康品质生活提升过程中的投资机会，在有效控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法分析宏观经济和资本市场发展趋势，综合考量宏观经济发展前景，评估各类资产的预期收益与风险，合理确定本基金在股票、债券等各类别资产上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时做出动态调整。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%。
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	95588
传真	010-63136700	010-66105798
注册地址	北京市顺义区天竺空港工业区A区	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	杨明辉	陈四清

2.4 信息披露方式

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
-------------	----------------

§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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	8,074,948.92
本期利润	43,591,153.79
加权平均基金份额本期利润	0.2485
本期加权平均净值利润率	24.26%
本期基金份额净值增长率	27.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	10,315,765.75
期末可供分配基金份额利润	0.0624
期末基金资产净值	184,682,371.23
期末基金份额净值	1.116
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	11.60%

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	2.95%	1.34%	1.61%	0.69%	1.34%	0.65%
过去三个月	1.09%	1.65%	-4.02%	0.81%	5.11%	0.84%
过去六个月	27.40%	1.68%	9.97%	0.86%	17.43%	0.82%
过去一年	-7.39%	1.74%	-6.88%	0.89%	-0.51%	0.85%
自基金合同生效起至今	11.60%	1.25%	5.77%	0.66%	5.83%	0.59%

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

华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2016 年 8 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 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。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累

了丰富的经验，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF 及华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、A 股市场指数、海外市场指数及信用债指数等较为完整的产品线。

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。根据银华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 2019 年 6 月 30 日数据），华夏移动互联网混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中排序 9/34；华夏稳增混合在“混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金（A 类）”中排序 8/27；华夏回报混合(H 类)在“混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金（非 A 类）”中排序 8/89；华夏鼎沛债券(A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 1/228；华夏理财 30 天债券(A 类)在“债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金（摊余成本法）（A 类）”中排序 10/40；华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 7/19；华夏上证 50AH 优选指数（LOF）(A 类) 在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（A 类）”中排序 8/29；华夏上证 50AH 优选指数（LOF）(C 类)在“标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非 A 类）”中排序 4/11；华夏上证 50ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 6/61；华夏消费 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中排序 3/31；华夏沪深 300ETF 联接(C 类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 9/34。

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。在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上，华夏安康债券、华夏收益债券（QDII）和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报 QDII 明星基金和 2018 年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏鼎茂债券（004042）荣获“2018 年度开放式债券型金牛基金”奖，华夏中小板 ETF（159902）荣获“2018 年度开放式指数型金牛基金”奖。

在客户服务方面，2019 年上半年度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金客服电话系统上线智能语音功能，客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金信息，同时系统还可以进行身份信息认证，主动告知业务办理进度，为客户提

供全面、准确、便捷的服务，提升客户体验；（2）直销电子交易平台开通华夏惠利货币 A 的快速赎回业务，为广大投资者的资金使用提供便利；（3）与微众银行、华融湘江银行、紫金农商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“你的今年收益知否？知否？”、“你的户口本更新了”、“户龄”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		
陈斌	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2016-08-03	-	10 年	清华大学北京协和医学院内科学博士。2009 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员等。

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遵规守信情况的说明

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》等法律法规和基金合同，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

自去年 12 月份“4+7”带量集采试点以来，医药行业处在控费、降价等一系列行业负面悲观预期

的压制下运行。上半年中证医药指数上涨 17.50%，申万医药指数上涨 21.38%；大幅跑输沪深 300 指数同期 27.07% 的涨幅。

报告期内，本基金坚持在行业内精选个股，一方面积极拥抱代表创新方向的公司，另一方面在被错杀的公司中审慎挑选投资标的，以高仓位回应市场的恐慌，上半年整体录得收益 27.40%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.116 元，本报告期份额净值增长率为 27.40%，同期业绩比较基准增长率为 9.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前，医药行业估值仍然处在整体偏低的水平。随着政策环境的逐步明朗，结合医药行业稳定的成长潜力，我们预计下半年医药行业有望跑赢市场。

同时，本基金继续重申对医药行业长期乐观的观点：全球医药创新正在进入到一个新的高产时期。肿瘤免疫、双特异性抗体、细胞基因治疗正在逐步走向成熟。据 IQVIA 预计未来 5 年，每年将有多达 50 个创新药获批上市，处在历史高位水平。同时，还将有 1200 亿美元的创新药将在未来 5 年中失去市场独占权，为仿制药厂商带来巨大的机会。另一方面，未来 30 年中国医药行业也将长期以快于 GDP 的速度持续增长。当前卫生费用占 GDP 的比重仅 6% 左右。随着老龄人口成为社会人口的主力，医疗卫生开支占 GDP 的比重必将持续上升。在这个持续扩张的过程中，医保控费将长期伴随。但是医保控费不会改变整体扩张的方向，而是不断促进行业内产品的结构性调整、技术升级和产品创新换代。因此，任何一次市场的群体性恐慌，都是长线布局医药行业优质资产的良好机会。

本基金将以较高仓位积极布局板块内的机会。我们的布局重点包括三个方面：一方面坚定产品研发管道丰富、有能力保证行业竞争低位、有能力保持持续内生增长的龙头公司。我们相信行业的压力将促进市场份额向这些公司集中。另一方面，我们在 OTC、商业、疫苗、服务等不受政策直接冲击的方向进行策略性布局，避免直接风险敞口的同时，保持对行业整体扩张的暴露。第三方面，我们在股价腰斩、估值降至历史最低位的“弹坑”中的公司里，选择行业地位稳固、竞争力仍然很强的公司进行逆向配置。我们期待三方面合力为组合在分散风险的同时，最大化持有人的收益。

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。会计师事务所对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

本报告期内，本基金托管人在对华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款		14,189,346.91	21,273,227.62
结算备付金		137,462.00	308,962.71
存出保证金		30,941.71	75,483.09
交易性金融资产		171,898,150.65	140,509,814.08
其中：股票投资		171,898,150.65	140,509,814.08
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,699.33	4,980.48
应收股利		-	-
应收申购款		54,726.33	43,636.91
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		186,313,326.93	162,216,104.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		771,714.94	98,227.94
应付管理人报酬		218,943.09	216,576.18
应付托管费		36,490.54	36,096.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		516,474.63	534,763.73

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		87,332.50	60,100.80
负债合计		1,630,955.70	945,764.67
所有者权益：		-	-
实收基金		165,413,415.55	184,104,164.34
未分配利润		19,268,955.68	-22,833,824.12
所有者权益合计		184,682,371.23	161,270,340.22
负债和所有者权益总计		186,313,326.93	162,216,104.89

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.116 元，基金份额总额 165,413,415.55 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		45,521,086.50	26,038,147.70
1.利息收入		57,146.42	194,363.78
其中：存款利息收入		57,146.42	114,608.49
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		-	79,755.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,810,828.33	8,985,073.79
其中：股票投资收益		7,914,922.72	8,162,243.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,895,905.61	822,830.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		35,516,204.87	16,723,999.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		136,906.88	134,710.43
减：二、费用		1,929,932.71	2,579,657.63

1.管理人报酬		1,332,924.48	1,645,478.84
2.托管费		222,154.14	274,246.51
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		286,637.90	588,084.45
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7.其他费用		88,216.19	71,847.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		43,591,153.79	23,458,490.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		43,591,153.79	23,458,490.07

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏乐享健康灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	184,104,164.34	-22,833,824.12	161,270,340.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,591,153.79	43,591,153.79
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）	-18,690,748.79	-1,488,373.99	-20,179,122.78
其中：1.基金申购款	31,929,038.22	1,247,292.05	33,176,330.27
2.基金赎回款	-50,619,787.01	-2,735,666.04	-53,355,453.05
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）	165,413,415.55	19,268,955.68	184,682,371.23
项目	上年度可比期间 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）	229,086,034.80	19,041,248.29	248,127,283.09

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,458,490.07	23,458,490.07
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）	-43,457,780.76	-4,377,525.73	-47,835,306.49
其中：1.基金申购款	55,059,305.28	11,018,341.17	66,077,646.45
2.基金赎回款	-98,517,086.04	-15,395,866.90	-113,912,952.94
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）	185,628,254.04	38,122,212.63	223,750,466.67

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：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
中国工商银行股份有限公司（"中国工商银行"）	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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	88,674,476.66	39.60%	260,077,089.16	65.18%

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 债券交易

无。

6.4.4.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	-	-	66,000,000.00	100.00%

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	64,846.97	43.76%	54,412.06	10.54%
关联方名称	上年度可比期间 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	190,193.47	61.70%	190,193.47	32.97%

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,332,924.48	1,645,478.84
其中：支付销售机构的客户维护费	285,496.53	311,465.28

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 1.50%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×1.50%/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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	222,154.14	274,246.51

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。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国工商银行活期存款	14,189,346.91	55,293.36	39,191,913.23	110,934.50

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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

6.4.5.1.1 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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新发流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至 2019 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 171,898,150.65 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2018 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 140,509,814.08 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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	171,898,150.65	92.26
	其中：股票	171,898,150.65	92.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	14,326,808.91	7.69

8	其他各项资产	88,367.37	0.05
9	合计	186,313,326.93	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	115,598.65	0.06
C	制造业	144,551,150.34	78.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,031,690.75	7.60
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,143,232.11	1.70
J	金融业	33,869.94	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,022,608.86	5.43
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	171,898,150.65	93.08

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300003	乐普医疗	645,291	14,854,598.82	8.04
2	600276	恒瑞医药	218,384	14,413,344.00	7.80
3	600529	山东药玻	539,056	12,279,695.68	6.65
4	002821	凯莱英	113,600	11,141,888.00	6.03
5	002422	科伦药业	366,400	10,893,072.00	5.90
6	300015	爱尔眼科	308,038	9,539,936.86	5.17
7	300142	沃森生物	286,500	8,125,140.00	4.40
8	601607	上海医药	440,709	7,998,868.35	4.33
9	300122	智飞生物	172,738	7,445,007.80	4.03

10	002262	恩华药业	678,200	7,317,778.00	3.96
----	--------	------	---------	--------------	------

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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	002044	美年健康	8,849,318.11	5.49
2	300142	沃森生物	6,898,033.20	4.28
3	300318	博晖创新	6,793,823.00	4.21
4	300122	智飞生物	6,786,083.51	4.21
5	603387	基蛋生物	6,740,401.89	4.18
6	300204	舒泰神	4,999,262.46	3.10
7	603456	九洲药业	4,995,966.20	3.10
8	300009	安科生物	4,995,380.00	3.10
9	002653	海思科	4,993,955.00	3.10
10	300601	康泰生物	4,496,876.00	2.79
11	300482	万孚生物	4,496,410.48	2.79
12	002332	仙琚制药	3,997,855.00	2.48
13	300451	创业慧康	3,995,812.00	2.48
14	002020	京新药业	3,497,260.00	2.17
15	002007	华兰生物	2,996,780.00	1.86
16	000028	国药一致	2,992,621.68	1.86
17	000650	仁和药业	2,848,246.00	1.77
18	002422	科伦药业	2,497,404.00	1.55
19	600529	山东药玻	2,196,380.99	1.36
20	300015	爱尔眼科	1,998,019.00	1.24

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	002007	华兰生物	9,003,590.29	5.58
2	002044	美年健康	8,344,923.09	5.17
3	600867	通化东宝	8,050,550.93	4.99
4	000650	仁和药业	8,002,007.82	4.96
5	300204	舒泰神	6,998,718.95	4.34
6	600201	生物股份	6,897,623.80	4.28

7	300482	万孚生物	5,625,314.47	3.49
8	002810	山东赫达	5,182,439.80	3.21
9	601607	上海医药	4,496,484.00	2.79
10	300318	博晖创新	4,287,153.85	2.66
11	000963	华东医药	4,218,365.65	2.62
12	300199	翰宇药业	3,432,405.54	2.13
13	300702	天宇股份	3,304,785.56	2.05
14	600529	山东药玻	3,298,134.40	2.05
15	002626	金达威	3,121,855.00	1.94
16	000028	国药一致	3,091,675.00	1.92
17	600276	恒瑞医药	2,789,585.87	1.73
18	600216	浙江医药	2,239,874.00	1.39
19	600518	ST 康美	2,150,695.62	1.33
20	600351	亚宝药业	2,000,397.00	1.24

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	106,551,044.97
卖出股票的收入（成交）总额	118,593,835.99

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	30,941.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,699.33
5	应收申购款	54,726.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,367.37

7.12.4 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。

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
6,758	24,476.68	805,441.84	0.49%	164,607,973.71	99.51%

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	212,398.50	0.13%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年8月3日）基金份额总额	1,448,718,626.78
本报告期期初基金份额总额	184,104,164.34
本报告期基金总申购份额	31,929,038.22
减：本报告期基金总赎回份额	50,619,787.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	165,413,415.55

§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 2019 年 3 月 2 日发布公告，李彬女士担任华夏基金管理有限公司督察长，周

璇女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

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	
中信证券	2	88,674,476.66	39.60%	64,846.97	43.76%	-
方正证券	1	60,755,152.71	27.13%	44,430.08	29.99%	-
国金证券	3	26,015,369.59	11.62%	3,416.04	2.31%	-
长江证券	1	24,256,348.19	10.83%	17,737.82	11.97%	-
长城证券	1	21,269,039.16	9.50%	15,554.10	10.50%	-
中泰证券	2	2,839,472.90	1.27%	2,076.48	1.40%	-
中国银河证券	4	120,185.70	0.05%	111.91	0.08%	-

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，本基金还选择了东北证券、国泰君安证券、上海证券、天风证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、中金公司、中投证券、中信建投证券、中银国际证券、招商证券、联讯证券、东方证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，中金公司的部分交易单元、联讯证券、长城证券、东方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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-

§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。

华夏基金管理有限公司

二〇一九年八月二十九日