

华夏智胜价值成长股票型发起式

证券投资基金

2019 年半年度报告

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：招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。

基金托管人招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。

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.....	5
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
§12 备查文件目录.....	45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金	
基金简称	华夏智胜价值成长股票	
基金主代码	002871	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 6 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	23,852,805.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
下属分级基金的交易代码	002871	002872
报告期末下属分级基金的份额总额	23,852,805.67 份	-份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，把握市场机会，追求资产的稳健增值。
投资策略	本基金主要通过采取资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、期权投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	沪深 300 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	招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	95555
传真	010-63136700	0755-83195201
注册地址	北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	杨明辉	李建红

2.4 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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
本期已实现收益	-147,805.37	-57,098.54
本期利润	1,624,276.61	-11,673.98
加权平均基金份额本期利润	0.1315	-0.0015
本期加权平均净值利润率	15.30%	-0.21%
本期基金份额净值增长率	20.88%	1.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
期末可供分配利润	-2,863,747.45	-
期末可供分配基金份额利润	-0.1201	-
期末基金资产净值	20,989,058.22	-
期末基金份额净值	0.8799	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金份额累计净值增长率	-8.87%	1.05%

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

华夏智胜价值成长股票 A

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%	1.07%	3.54%	1.10%	-0.59%	-0.03%
过去三个月	-3.92%	1.44%	-3.36%	1.42%	-0.56%	0.02%
过去六个月	20.88%	1.44%	23.21%	1.40%	-2.33%	0.04%
过去一年	5.38%	1.38%	8.31%	1.37%	-2.93%	0.01%
自基金合同生效起至今	-8.87%	1.32%	-4.68%	1.32%	-4.19%	0.00%

华夏智胜价值成长股票 C

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
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 7 日	1.95%	1.99%	1.38%	1.45%	0.57%	0.54%
2018 年 12 月 26 日至 2019 年 1 月 7 日	1.05%	1.29%	0.51%	1.06%	0.54%	0.23%

注：2019 年 1 月 7 日至 2019 年 6 月 30 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

3.2.2 自基金转型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

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

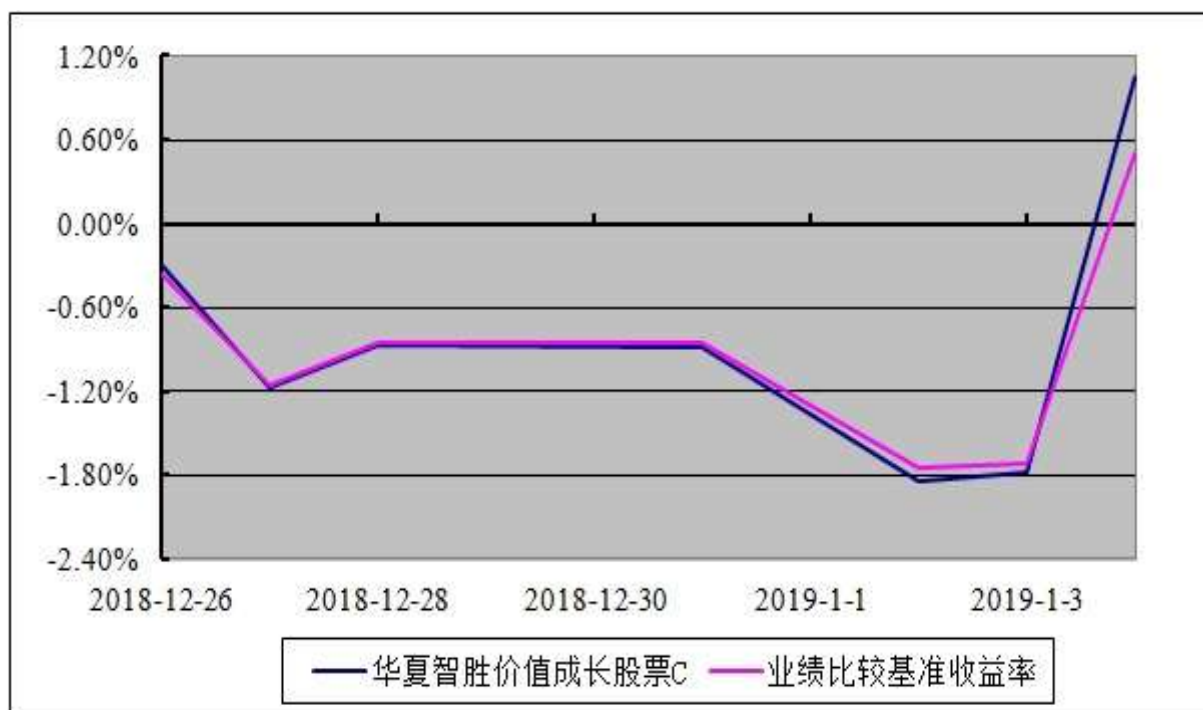
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 3 月 6 日至 2019 年 6 月 30 日)

华夏智胜价值成长股票 A



华夏智胜价值成长股票 C



注：①根据华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

②2019 年 1 月 7 日至 2019 年 6 月 30 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

§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 2019 年 6 月 30 日数据),华夏移动互联混合(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		
荣膺	本基金的基金 经理、数量投 资部高级副 总裁	2018-03-06	-	9 年	北京大学光华管理学院会计学硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理，MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年

					10月20日至2018年9月16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》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

上半年，国际方面，世界经济增长、国际贸易增长动能继续放缓，下行压力倍增，海外货币政策取向已有所松动，美联储释放出更多鸽派信号，降息概率明显上升，部分新兴市场国家已经进入降息通道。国内方面，1 季度政策全面放松，央行释放流动性，宽货币向宽信用传导出现良好迹象。绝大多数宏观经济指标的表现比较平稳，一部分指标趋势向好，从投资、消费数据来看，国内需求呈现稳中有升的态势；从生产端及需求端数据来看，3 月制造业 PMI 超预期回升，重回荣枯线上方，经济结构优化的趋势在延续。2 季度中美贸易冲突升级并延伸至技术、金融领域，中国经济面临来自外围环境的压力。国内货币政策维持平稳，部分中小银行同业风险对金融市场信用偏好造成不利影响，后央行批量调整头部券商短融余额上限，以此传导流动性，市场压力得到缓解。从总的情况来看，无论是经济的增长、就业，还是物价和国际收支这四大指标，中国经济运行保持在合理区间，

今年以来总体表现平稳，增长动力加快转换。

市场方面，在经历了 2018 年的大跌之后，1 季度 A 股市场喜迎开门红，上证综指快速反弹至 3000 点上方，沪深两市成交金额突破了万亿元。政策环境转暖、外资等长期资金涌入等促使 A 股市场投资者情绪逐步高涨，估值低、弹性较大的中小盘风格指数补涨反弹势力最为强劲。4 月，A 股指数在流动性修复边际递减、中美贸易摩擦等因素下出现一定幅度回调。而后，在国内经济金融领域结构调整积极变化预期下，以及 MSCI 和 FTSE 提高 A 股在全球股票指数占比，北向资金加速流入 A 股布局等因素作用下，市场信心得到修复，A 股指数再度企稳回升。

基金投资运作方面，本基金在做好实施既定投资策略的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 份额净值为 0.8799 元，本报告期份额净值增长率为 20.88%，同期业绩比较基准收益率为 23.21%；华夏智胜价值成长股票 C 份额净值为 0 元，本报告期份额净值增长率为 1.95%，同期业绩比较基准收益率为 1.38%。

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，全球经济前景面临的主要风险来自于贸易谈判的结果和未来几个月金融市场情绪变化的方向。国际方面，在经济增长触顶的推动下，美联储货币政策或将自 2015 年底长时间加息通道后发生转向，美股存在变化或回落风险；而以欧元区为代表的主要发达经济体的经济则仍大概率持续低迷。国内方面，经济发展的外部环境仍旧复杂严峻，国内的结构性矛盾仍然突出，政策层面或将持续托底，维护增速稳定，但全面货币政策宽松的可能性亦较低。

目前 A 股估值处于合理水平，但部分上市公司盈利增速下滑且尚未企稳，市场震荡企稳过程中，符合经济转型方向的板块已逐步迎来中长线投资窗口。此外，外资增配 A 股的整体大趋势不变，2019 年下半年更多的海外资金仍将持续流入 A 股市场，龙头中盘股受到边际增量资金推动效应将尤为明显，科创板的推出有望加速 A 股改革进程，实现科技、资本和实体经济的良性循环，对市场情绪起到持续提振效用。

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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	6.4.7.1	2,445,007.53	1,693,653.99
结算备付金		27,296.41	19,415.34
存出保证金		5,461.35	1,842.25
交易性金融资产	6.4.7.2	18,589,616.08	14,336,265.99
其中：股票投资		18,589,616.08	14,332,650.39
基金投资		-	-
债券投资		-	3,615.60
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	597.43	448.06
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		21,067,978.80	16,051,625.63
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		396.09	-
应付管理人报酬		9,857.17	8,284.62
应付托管费		1,971.40	1,656.92
应付销售服务费		-	267.65
应付交易费用	6.4.7.7	19,992.16	11,404.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	46,703.76	50,000.00
负债合计		78,920.58	71,614.00
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	23,852,805.67	21,954,255.17
未分配利润	6.4.7.10	-2,863,747.45	-5,974,243.54
所有者权益合计		20,989,058.22	15,980,011.63
负债和所有者权益总计		21,067,978.80	16,051,625.63

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值 0.8799 元；华夏智

胜价值成长股票基金份额总额 23,852,805.67 份（其中 A 类 23,852,805.67 份，C 类 0.00 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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 3 月 6 日（基金 合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		1,770,306.32	-1,314,586.21
1.利息收入		5,039.17	4,261.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,021.37	3,281.36
债券利息收入		17.80	0.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	979.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-96,457.02	-131,365.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-204,323.72	-208,722.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,194.54	66.19
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	105,672.16	77,291.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,817,506.54	-1,187,841.75
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	44,217.63	359.46
减：二、费用		157,703.69	127,973.72
1.管理人报酬		53,323.67	32,610.68
2.托管费		10,664.69	6,522.15
3.销售服务费		221.51	-
4.交易费用	6.4.7.20	46,260.51	50,209.80
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	6.4.7.21	47,233.31	38,631.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,612,602.63	-1,442,559.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,612,602.63	-1,442,559.93

注：自 2018 年 3 月 6 日起，原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金，上年度可比期间自 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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）	21,954,255.17	-5,974,243.54	15,980,011.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,612,602.63	1,612,602.63
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）	1,898,550.50	1,497,893.46	3,396,443.96
其中：1.基金申购款	13,782,888.43	-1,563,787.12	12,219,101.31
2.基金赎回款	-11,884,337.93	3,061,680.58	-8,822,657.35
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）	23,852,805.67	-2,863,747.45	20,989,058.22
项目	上年度可比期间 2018 年 3 月 6 日（基金合同生效日）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）	10,903,772.92	-376,090.65	10,527,682.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,442,559.93	-1,442,559.93
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）	208,640.41	-15,122.28	193,518.13
其中：1.基金申购款	269,573.62	-19,380.29	250,193.33
2.基金赎回款	-60,933.21	4,258.01	-56,675.20
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）	-	-	-

“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	11,112,413.33	-1,833,772.86	9,278,640.47

注：自 2018 年 3 月 6 日起，原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金，上年度可比期间自 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日。

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 基金基本情况

根据原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华夏新锦源混合”）基金份额持有人大会审议通过的《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，华夏新锦源混合于 2018 年 3 月 6 日转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券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。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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。
- 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、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。

7、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。

8、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。

9、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。

10、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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,445,007.53
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	2,445,007.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	18,085,116.91	18,589,616.08	504,499.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	18,085,116.91	18,589,616.08	504,499.17

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 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	582.63
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	12.30
应收债券利息	-
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	2.50
合计	597.43

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 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	19,992.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	19,992.16

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	0.41
预提费用	46,703.35
合计	46,703.76

6.4.7.9 实收基金

华夏智胜价值成长股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	11,224,407.68	11,224,407.68
本期申购	13,782,888.43	13,782,888.43
本期赎回（以“-”号填列）	-1,154,490.44	-1,154,490.44
本期末	23,852,805.67	23,852,805.67

华夏智胜价值成长股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	10,729,847.49	10,729,847.49
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-10,729,847.49	-10,729,847.49

6.4.7.10 未分配利润

华夏智胜价值成长股票 A

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	-527,529.65	-2,526,875.22	-3,054,404.87
本期利润	-147,805.37	1,772,081.98	1,624,276.61
本期基金份额交易产生的变动数	-813,710.93	-619,908.26	-1,433,619.19
其中：基金申购款	-894,539.11	-669,248.01	-1,563,787.12
基金赎回款	80,828.18	49,339.75	130,167.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,489,045.95	-1,374,701.50	-2,863,747.45

华夏智胜价值成长股票 C

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	-504,221.93	-2,415,616.74	-2,919,838.67
本期利润	-57,098.54	45,424.56	-11,673.98

本期基金份额交易产生的变动数	561,320.47	2,370,192.18	2,931,512.65
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	561,320.47	2,370,192.18	2,931,512.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	4,685.65
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	290.95
其他	44.77
合计	5,021.37

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	14,544,521.70
减：卖出股票成本总额	14,748,845.42
买卖股票差价收入	-204,323.72

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,318.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,100.00
减：应收利息总额	23.59
买卖债券差价收入	2,194.54

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 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	105,672.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	105,672.16

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	1,817,506.54
——股票投资	1,817,122.14
——债券投资	384.40
——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	1,817,506.54

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	44,217.63
合计	44,217.63

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	46,260.51
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	46,260.51

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	26,867.56
银行费用	529.96
银行间账户维护费	-
其他	-
合计	47,233.31

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

招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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。

6.4.10 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月6日（基金合同生效日）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	17,814,746.97	56.17%	36,239,272.08	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

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3月6日（基金合同生效日）至 2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	11,150.23	36.78%	2,066.60	100.00%

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月6日（基金合同生效日）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	-	-	1,000,000.00	100.00%

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 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	16,590.87	57.40%	13,061.66	65.33%
关联方名称	上年度可比期间 2018年3月6日（基金合同生效日）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	33,748.46	100.00%	24,861.99	100.00%

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年3月6日（基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	53,323.67	32,610.68
其中：支付销售机构的客户维护费	3.56	-

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 1.00%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×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 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3月6日（基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,664.69	6,522.15

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	221.51	221.51
合计	-	221.51	221.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年3月6日（基金合同生效日）至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额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，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 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

份额单位：份

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3月6日（基金合同生效日）至 2018年6月30日	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
期初持有的基金份额	10,608,423.83	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动	-	-	-	-

份额				
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,608,423.83	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	44.47%	-	-	-

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月6日（基金合同生效日） 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
招商银行活期存款	2,445,007.53	4,685.65	792,276.47	2,921.81

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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（2019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
601236	红塔证	2019-06-27	2019-07-05	新发流通受限	3.46	3.46	1,000	3,460.00	3,460.00	-

	券									
--	---	--	--	--	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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。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，本基金所投资的证券均能及

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。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	18,589,616.08	88.57	14,332,650.39	89.69
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	18,589,616.08	88.57	14,332,650.39	89.69

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	+5%	947,622.47	713,717.98
	-5%	-947,622.47	-713,717.98

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 各层级金融工具公允价值

截至 2019 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 18,589,616.08 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 14,336,265.99 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

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	18,589,616.08	88.24
	其中：股票	18,589,616.08	88.24
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	2,472,303.94	11.73
8	其他各项资产	6,058.78	0.03
9	合计	21,067,978.80	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	58,779.00	0.28
B	采矿业	362,872.00	1.73
C	制造业	8,819,606.40	42.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	742,635.00	3.54
E	建筑业	689,588.20	3.29
F	批发和零售业	729,636.10	3.48
G	交通运输、仓储和邮政业	593,590.00	2.83
H	住宿和餐饮业	55,242.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	509,137.00	2.43
J	金融业	4,246,040.78	20.23
K	房地产业	821,414.20	3.91
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	380,853.20	1.81
N	水利、环境和公共设施管理业	437,278.60	2.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	57,813.60	0.28
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	64,610.00	0.31
S	综合	20,520.00	0.10
	合计	18,589,616.08	88.57

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	601318	中国平安	11,200	992,432.00	4.73
2	601166	兴业银行	14,600	267,034.00	1.27
3	601328	交通银行	28,300	173,196.00	0.83
4	600016	民生银行	25,580	162,433.00	0.77
5	600837	海通证券	10,700	151,833.00	0.72
6	601288	农业银行	39,400	141,840.00	0.68
7	600000	浦发银行	12,100	141,328.00	0.67
8	000002	万科 A	5,000	139,050.00	0.66
9	601601	中国太保	3,800	138,738.00	0.66
10	601398	工商银行	22,200	130,758.00	0.62
11	600801	华新水泥	6,440	130,410.00	0.62
12	000001	平安银行	8,800	121,264.00	0.58
13	603599	广信股份	7,900	115,893.00	0.55
14	000035	中国天楹	18,600	111,600.00	0.53
15	300737	科顺股份	11,800	110,920.00	0.53
16	600585	海螺水泥	2,600	107,900.00	0.51
17	300190	维尔利	13,900	107,447.00	0.51
18	601233	桐昆股份	6,900	107,019.00	0.51

19	603388	元成股份	12,720	106,339.20	0.51
20	601169	北京银行	17,900	105,789.00	0.50
21	300732	设研院	5,300	105,735.00	0.50
22	300657	弘信电子	4,600	104,880.00	0.50
23	600792	云煤能源	27,700	103,598.00	0.49
24	603878	武进不锈	9,520	102,340.00	0.49
25	603258	电魂网络	3,800	101,498.00	0.48
26	600609	金杯汽车	24,400	101,016.00	0.48
27	601211	国泰君安	5,500	100,925.00	0.48
28	601988	中国银行	26,400	98,736.00	0.47
29	601688	华泰证券	4,300	95,976.00	0.46
30	002135	东南网架	17,000	94,180.00	0.45
31	603811	诚意药业	4,700	94,000.00	0.45
32	300031	宝通科技	7,600	93,936.00	0.45
33	600048	保利地产	7,300	93,148.00	0.44
34	600793	宜宾纸业	5,300	92,485.00	0.44
35	002425	凯撒文化	14,200	91,874.00	0.44
36	603638	艾迪精密	4,068	91,530.00	0.44
37	601717	郑煤机	15,900	90,789.00	0.43
38	603558	健盛集团	10,300	89,095.00	0.42
39	002851	麦格米特	4,500	88,965.00	0.42
40	300735	光弘科技	5,200	88,816.00	0.42
41	603903	中持股份	5,460	88,342.80	0.42
42	300320	海达股份	18,500	88,060.00	0.42
43	300232	洲明科技	9,000	87,120.00	0.42
44	002641	永高股份	21,300	86,478.00	0.41
45	300569	天能重工	7,250	84,535.00	0.40
46	002838	道恩股份	7,500	84,000.00	0.40
47	300443	金雷股份	5,800	83,984.00	0.40
48	002399	海普瑞	4,000	83,960.00	0.40
49	300425	环能科技	15,200	83,448.00	0.40
50	000543	皖能电力	17,700	83,367.00	0.40
51	000899	赣能股份	15,800	83,108.00	0.40
52	000498	山东路桥	15,600	82,836.00	0.39
53	002541	鸿路钢构	10,400	82,264.00	0.39
54	300470	日机密封	3,300	81,972.00	0.39
55	600332	白云山	2,000	81,940.00	0.39
56	603018	中设集团	6,556	81,622.20	0.39
57	600787	中储股份	14,200	81,366.00	0.39
58	601005	重庆钢铁	40,300	81,003.00	0.39
59	002406	远东传动	13,500	81,000.00	0.39
60	600811	东方集团	21,700	80,724.00	0.38
61	300609	汇纳科技	2,300	80,638.00	0.38

62	600882	妙可蓝多	7,100	80,514.00	0.38
63	600727	鲁北化工	12,000	79,920.00	0.38
64	002790	瑞尔特	11,800	79,768.00	0.38
65	601229	上海银行	6,660	78,921.00	0.38
66	002150	通润装备	14,200	78,668.00	0.37
67	002322	理工环科	6,200	77,996.00	0.37
68	600582	天地科技	22,600	77,970.00	0.37
69	300130	新国都	4,900	77,910.00	0.37
70	600055	万东医疗	7,500	77,850.00	0.37
71	603100	川仪股份	8,400	77,196.00	0.37
72	002475	立讯精密	3,100	76,849.00	0.37
73	300391	康跃科技	10,500	76,545.00	0.36
74	600808	马钢股份	22,200	75,702.00	0.36
75	600596	新安股份	7,000	75,320.00	0.36
76	603260	合盛硅业	1,600	75,296.00	0.36
77	601339	百隆东方	16,600	75,198.00	0.36
78	603588	高能环境	7,000	74,690.00	0.36
79	002381	双箭股份	9,300	73,935.00	0.35
80	603520	司太立	3,200	73,920.00	0.35
81	601818	光大银行	19,300	73,533.00	0.35
82	300326	凯利泰	8,100	73,305.00	0.35
83	000601	韶能股份	15,200	72,808.00	0.35
84	603181	皇马科技	4,900	72,765.00	0.35
85	002788	鹭燕医药	9,100	72,436.00	0.35
86	603586	金麒麟	4,500	72,000.00	0.34
87	601898	中煤能源	15,000	72,000.00	0.34
88	601872	招商轮船	16,400	71,504.00	0.34
89	600863	内蒙华电	22,500	70,650.00	0.34
90	000963	华东医药	2,700	70,092.00	0.33
91	002024	苏宁易购	6,100	70,028.00	0.33
92	603806	福斯特	1,900	69,787.00	0.33
93	601186	中国铁建	7,000	69,650.00	0.33
94	300715	凯伦股份	3,300	69,432.00	0.33
95	002382	蓝帆医疗	5,000	69,100.00	0.33
96	600452	涪陵电力	3,900	68,874.00	0.33
97	603277	银都股份	7,100	68,870.00	0.33
98	002444	巨星科技	6,900	68,862.00	0.33
99	601919	中远海控	13,700	68,774.00	0.33
100	300575	中旗股份	2,400	68,544.00	0.33
101	000157	中联重科	11,400	68,514.00	0.33
102	300196	长海股份	7,500	68,400.00	0.33
103	600578	京能电力	21,100	68,364.00	0.33
104	600026	中远海能	10,500	68,145.00	0.32

105	000544	中原环保	9,000	68,130.00	0.32
106	600984	建设机械	10,400	68,120.00	0.32
107	601992	金隅集团	18,000	67,680.00	0.32
108	600188	兖州煤业	6,200	67,394.00	0.32
109	000623	吉林敖东	4,100	67,199.00	0.32
110	601766	中国中车	8,300	67,147.00	0.32
111	002776	柏堡龙	4,100	67,035.00	0.32
112	600039	四川路桥	18,400	66,976.00	0.32
113	601666	平煤股份	16,000	66,880.00	0.32
114	001872	招商港口	4,100	66,871.00	0.32
115	600444	国机通用	5,700	66,861.00	0.32
116	603855	华荣股份	7,600	66,728.00	0.32
117	002730	电光科技	8,400	66,696.00	0.32
118	002598	山东章鼓	9,600	66,240.00	0.32
119	600699	均胜电子	3,100	66,216.00	0.32
120	603339	四方科技	4,300	66,134.00	0.32
121	601000	唐山港	24,000	66,000.00	0.31
122	600025	华能水电	16,200	65,934.00	0.31
123	600252	中恒集团	22,500	65,925.00	0.31
124	600865	百大集团	10,800	65,880.00	0.31
125	600512	腾达建设	23,100	65,835.00	0.31
126	600170	上海建工	17,500	65,800.00	0.31
127	002833	弘亚数控	1,800	65,538.00	0.31
128	002142	宁波银行	2,700	65,448.00	0.31
129	300382	斯莱克	10,500	65,310.00	0.31
130	600070	浙江富润	8,000	64,960.00	0.31
131	000779	三毛派神	6,100	64,721.00	0.31
132	600655	豫园股份	7,900	64,701.00	0.31
133	000719	中原传媒	9,100	64,610.00	0.31
134	600982	宁波热电	19,000	64,600.00	0.31
135	300677	英科医疗	4,000	64,240.00	0.31
136	603298	杭叉集团	5,000	63,300.00	0.30
137	300276	三丰智能	7,500	63,300.00	0.30
138	300341	麦克奥迪	11,500	62,100.00	0.30
139	600340	华夏幸福	1,900	61,883.00	0.29
140	603889	新澳股份	9,100	61,880.00	0.29
141	002099	海翔药业	8,700	61,770.00	0.29
142	002738	中矿资源	3,500	61,740.00	0.29
143	000401	冀东水泥	3,500	61,635.00	0.29
144	600177	雅戈尔	9,700	61,595.00	0.29
145	601939	建设银行	8,200	61,008.00	0.29
146	600919	江苏银行	8,400	60,984.00	0.29
147	300389	艾比森	4,900	60,760.00	0.29

148	002120	韵达股份	1,950	60,099.00	0.29
149	002272	川润股份	10,900	59,950.00	0.29
150	600999	招商证券	3,500	59,815.00	0.28
151	002438	江苏神通	7,300	59,714.00	0.28
152	601009	南京银行	7,200	59,472.00	0.28
153	300559	佳发教育	2,500	59,275.00	0.28
154	002760	凤形股份	3,200	58,976.00	0.28
155	002088	鲁阳节能	4,800	58,800.00	0.28
156	002234	民和股份	2,100	58,779.00	0.28
157	000027	深圳能源	9,400	58,280.00	0.28
158	601567	三星医疗	10,000	58,000.00	0.28
159	002621	美吉姆	4,420	57,813.60	0.28
160	300702	天宇股份	1,600	57,664.00	0.27
161	002791	坚朗五金	3,600	56,988.00	0.27
162	002443	金洲管道	7,900	56,801.00	0.27
163	002882	金龙羽	4,700	56,729.00	0.27
164	601628	中国人寿	2,000	56,640.00	0.27
165	002563	森马服饰	5,100	56,406.00	0.27
166	600741	华域汽车	2,600	56,160.00	0.27
167	603601	再升科技	7,020	55,879.20	0.27
168	001965	招商公路	6,700	55,811.00	0.27
169	000999	华润三九	1,900	55,746.00	0.27
170	002478	常宝股份	9,200	55,660.00	0.27
171	002605	姚记扑克	5,300	55,650.00	0.27
172	300396	迪瑞医疗	3,200	55,616.00	0.26
173	002749	国光股份	4,760	55,549.20	0.26
174	000524	岭南控股	6,600	55,242.00	0.26
175	000672	上峰水泥	4,500	55,215.00	0.26
176	603568	伟明环保	2,565	55,198.80	0.26
177	002404	嘉欣丝绸	9,500	55,195.00	0.26
178	300483	沃施股份	1,500	55,080.00	0.26
179	600153	建发股份	6,200	55,056.00	0.26
180	601336	新华保险	1,000	55,030.00	0.26
181	000828	东莞控股	6,000	55,020.00	0.26
182	000425	徐工机械	12,300	54,858.00	0.26
183	000811	冰轮环境	6,200	54,746.00	0.26
184	002379	宏创控股	16,500	54,615.00	0.26
185	002616	长青集团	7,500	54,375.00	0.26
186	300690	双一科技	2,400	53,760.00	0.26
187	600104	上汽集团	2,100	53,550.00	0.26
188	300019	硅宝科技	7,800	52,416.00	0.25
189	002097	山河智能	8,300	51,792.00	0.25
190	000919	金陵药业	6,600	51,546.00	0.25

191	000949	新乡化纤	17,700	51,507.00	0.25
192	000090	天健集团	10,400	51,376.00	0.24
193	603979	金诚信	6,100	51,362.00	0.24
194	600251	冠农股份	8,000	50,720.00	0.24
195	300546	雄帝科技	2,000	50,380.00	0.24
196	603496	恒为科技	1,800	50,364.00	0.24
197	603916	苏博特	3,900	50,310.00	0.24
198	001979	招商蛇口	2,400	50,160.00	0.24
199	300464	星徽精密	6,200	49,538.00	0.24
200	000049	德赛电池	1,900	49,457.00	0.24
201	300082	奥克股份	7,500	49,425.00	0.24
202	600389	江山股份	2,300	48,530.00	0.23
203	600015	华夏银行	6,300	48,510.00	0.23
204	002884	凌霄泵业	3,300	48,444.00	0.23
205	600295	鄂尔多斯	5,800	48,082.00	0.23
206	603929	亚翔集成	2,800	47,684.00	0.23
207	603730	岱美股份	2,000	46,880.00	0.22
208	600958	东方证券	4,300	45,924.00	0.22
209	603077	和邦生物	23,400	44,460.00	0.21
210	603108	润达医疗	4,200	44,436.00	0.21
211	600261	阳光照明	12,100	44,407.00	0.21
212	000166	申万宏源	8,800	44,088.00	0.21
213	601155	新城控股	1,100	43,791.00	0.21
214	601369	陕鼓动力	6,600	43,758.00	0.21
215	603699	纽威股份	3,600	43,200.00	0.21
216	600802	福建水泥	5,200	42,900.00	0.20
217	603161	科华控股	2,900	42,282.00	0.20
218	601677	明泰铝业	4,100	42,271.00	0.20
219	600351	亚宝药业	6,800	41,820.00	0.20
220	601607	上海医药	2,300	41,745.00	0.20
221	000776	广发证券	3,000	41,220.00	0.20
222	603669	灵康药业	5,320	39,900.00	0.19
223	603716	塞力斯	2,300	39,399.00	0.19
224	600420	现代制药	4,400	39,248.00	0.19
225	601618	中国中冶	12,800	38,912.00	0.19
226	600250	南纺股份	5,300	38,849.00	0.19
227	603856	东宏股份	3,800	38,760.00	0.18
228	600483	福能股份	4,500	38,520.00	0.18
229	601377	兴业证券	5,700	38,418.00	0.18
230	603808	歌力思	2,500	38,175.00	0.18
231	600623	华谊集团	4,900	37,436.00	0.18
232	600387	海越能源	4,730	36,752.10	0.18
233	600256	广汇能源	10,100	35,956.00	0.17

234	601901	方正证券	5,000	35,550.00	0.17
235	600705	中航资本	6,400	34,688.00	0.17
236	603367	辰欣药业	2,300	33,235.00	0.16
237	002736	国信证券	2,500	32,900.00	0.16
238	000783	长江证券	4,000	31,240.00	0.15
239	601555	东吴证券	2,900	29,725.00	0.14
240	000069	华侨城 A	4,200	29,190.00	0.14
241	600383	金地集团	2,300	27,439.00	0.13
242	601788	光大证券	2,400	27,408.00	0.13
243	600606	绿地控股	3,800	25,954.00	0.12
244	600109	国金证券	2,500	24,300.00	0.12
245	601108	财通证券	2,200	24,156.00	0.12
246	600061	国投资本	1,600	22,416.00	0.11
247	600926	杭州银行	2,520	20,991.60	0.10
248	600895	张江高科	1,000	20,520.00	0.10
249	601997	贵阳银行	2,340	20,241.00	0.10
250	601198	东兴证券	1,700	20,196.00	0.10
251	601881	中国银河	1,600	19,600.00	0.09
252	000728	国元证券	2,100	19,257.00	0.09
253	600369	西南证券	3,700	18,278.00	0.09
254	002673	西部证券	1,800	18,144.00	0.09
255	600325	华发股份	2,200	17,182.00	0.08
256	002146	荣盛发展	1,800	16,902.00	0.08
257	000961	中南建设	1,900	16,454.00	0.08
258	600848	上海临港	500	15,565.00	0.07
259	600376	首开股份	1,700	15,181.00	0.07
260	000750	国海证券	3,000	15,090.00	0.07
261	601838	成都银行	1,700	15,011.00	0.07
262	601878	浙商证券	1,600	14,880.00	0.07
263	600816	安信信托	2,940	14,847.00	0.07
264	002500	山西证券	1,800	14,580.00	0.07
265	600909	华安证券	2,200	14,388.00	0.07
266	600968	海油发展	4,000	14,200.00	0.07
267	601128	常熟银行	1,800	13,896.00	0.07
268	000656	金科股份	2,300	13,869.00	0.07
269	600208	新湖中宝	4,400	13,816.00	0.07
270	000686	东北证券	1,500	13,215.00	0.06
271	000627	天茂集团	1,900	12,331.00	0.06
272	600266	北京城建	1,440	11,606.40	0.06
273	000671	阳光城	1,700	11,016.00	0.05
274	600649	城投控股	1,700	10,999.00	0.05
275	002670	国盛金控	820	10,332.00	0.05
276	600158	中体产业	1,000	10,230.00	0.05

277	000402	金融街	1,300	10,192.00	0.05
278	600643	爱建集团	1,051	10,068.58	0.05
279	600064	南京高科	880	9,424.80	0.04
280	600155	华创阳安	700	9,401.00	0.04
281	600466	蓝光发展	1,500	9,330.00	0.04
282	000563	陕国投 A	2,100	9,324.00	0.04
283	600823	世茂股份	2,000	9,220.00	0.04
284	601066	中信建投	400	8,432.00	0.04
285	600748	上实发展	1,000	8,290.00	0.04
286	000732	泰禾集团	500	8,250.00	0.04
287	002797	第一创业	1,300	8,242.00	0.04
288	600503	华丽家族	2,100	7,980.00	0.04
289	000031	大悦城	1,200	7,704.00	0.04
290	000667	美好置业	2,700	7,101.00	0.03
291	002244	滨江集团	1,600	6,640.00	0.03
292	600390	五矿资本	700	6,601.00	0.03
293	000712	锦龙股份	500	6,420.00	0.03
294	600094	大名城	1,000	6,290.00	0.03
295	600908	无锡银行	1,100	6,204.00	0.03
296	002285	世联行	1,300	5,863.00	0.03
297	000926	福星股份	800	5,536.00	0.03
298	000006	深振业 A	1,000	5,450.00	0.03
299	002807	江阴银行	1,120	5,241.60	0.02
300	000718	苏宁环球	1,500	5,190.00	0.02
301	002839	张家港行	900	5,067.00	0.02
302	600639	浦东金桥	300	4,851.00	0.02
303	600773	西藏城投	700	4,711.00	0.02
304	600053	九鼎投资	200	4,660.00	0.02
305	600657	信达地产	1,100	4,532.00	0.02
306	600901	江苏租赁	700	4,263.00	0.02
307	600291	西水股份	400	4,024.00	0.02
308	601698	中国卫通	1,000	3,920.00	0.02
309	000537	广宇发展	500	3,460.00	0.02
310	601236	红塔证券	1,000	3,460.00	0.02
311	600565	迪马股份	900	3,357.00	0.02
312	600743	华远地产	1,200	3,012.00	0.01
313	601990	南京证券	300	2,973.00	0.01
314	000987	越秀金控	300	2,706.00	0.01

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	601318	中国平安	395,913.00	2.48
2	002788	鹭燕医药	129,696.00	0.81
3	601166	兴业银行	126,822.00	0.79
4	002399	海普瑞	126,688.00	0.79
5	002541	鸿路钢构	123,725.50	0.77
6	300196	长海股份	121,550.00	0.76
7	300737	科顺股份	114,500.00	0.72
8	300389	艾比森	113,750.00	0.71
9	002382	蓝帆医疗	111,982.00	0.70
10	002444	巨星科技	110,125.00	0.69
11	300732	设研院	108,568.28	0.68
12	002120	韵达股份	106,804.00	0.67
13	300382	斯莱克	105,669.00	0.66
14	300657	弘信电子	102,225.00	0.64
15	603258	电魂网络	101,438.00	0.63
16	300031	宝通科技	100,015.00	0.63
17	603558	健盛集团	96,180.00	0.60
18	000035	中国天楹	96,100.00	0.60
19	002135	东南网架	95,810.00	0.60
20	002438	江苏神通	95,133.00	0.60

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	601318	中国平安	248,248.00	1.55
2	603113	金能科技	233,698.00	1.46
3	002757	南兴股份	172,922.00	1.08
4	300389	艾比森	151,088.00	0.95
5	002809	红墙股份	143,626.00	0.90
6	000636	风华高科	140,121.00	0.88
7	000651	格力电器	138,842.00	0.87
8	002083	孚日股份	135,030.00	0.84
9	300132	青松股份	133,437.00	0.84
10	002717	岭南股份	133,399.00	0.83
11	300398	飞凯材料	132,272.00	0.83
12	300172	中电环保	131,796.00	0.82
13	300243	瑞丰高材	130,031.00	0.81
14	300261	雅本化学	128,624.00	0.80
15	300164	通源石油	127,014.00	0.79
16	300577	开润股份	125,685.00	0.79

17	002225	濮耐股份	124,852.00	0.78
18	300632	光莆股份	124,534.00	0.78
19	300388	国祯环保	124,017.00	0.78
20	603716	塞力斯	123,990.00	0.78

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	17,188,688.97
卖出股票的收入（成交）总额	14,544,521.70

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、交通银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	5,461.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	597.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,058.78

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

份额级别	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	持有份额	占总份

				额比例		额比例
华夏智胜价值成长股票 A	203	117,501.51	21,809,810.75	91.43%	2,042,994.92	8.57%
华夏智胜价值成长股票 C	-	-	-	-	-	-
合计	203	117,501.51	21,809,810.75	91.43%	2,042,994.92	8.57%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华夏智胜价值成长股票 A	98,531.91	0.41%
	华夏智胜价值成长股票 C	-	-
	合计	98,531.91	0.41%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	华夏智胜价值成长股票 A	0~10
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏智胜价值成长股票 A	0
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,608,423.83	44.47%	10,356,255.18	43.42%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,608,423.83	44.47%	10,356,255.18	43.42%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 6 日）基金份额总额	600,757,177.05	-
本报告期期初基金份额总额	11,224,407.68	10,729,847.49
本报告期基金总申购份额	13,782,888.43	-
减：本报告期基金总赎回份额	1,154,490.44	10,729,847.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,852,805.67	-

§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	佣金	占当期佣金总	

			交总额的 比例		量的比 例	
中信证券	2	17,814,746.97	56.17%	16,590.87	57.40%	-
中金公司	2	6,967,417.40	21.97%	5,853.80	20.25%	-
光大证券	1	6,933,446.30	21.86%	6,457.32	22.34%	-

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，本基金还选择了国泰君安证券、华泰证券、申万宏源证券、招商证券、中信建投证券、中银国际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
中信证券	11,150.23	36.78%	-	-
中金公司	-	-	-	-
光大证券	19,167.90	63.22%	-	-

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公告	中国证监会指定报刊及	2019-03-02

		网站	
2	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	2019-03-26
3	华夏基金管理有限公司关于提示投资者在中国结算办理场内账户对应关系维护业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09
4	华夏基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善客户身份信息资料的特别提示公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-04
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增通华财富(上海)基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-18

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-01-01 至 2019-01-06, 2019-06-26 至 2019-06-30	10,729,847.49	11,201,386.92	10,729,847.49	11,201,386.92	46.96%
	2	2019-01-01 至 2019-06-30	10,608,423.83	-	-	10,608,423.83	44.47%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会准予基金转型的文件；

12.1.2 《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏智胜价值成长股票型发起式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

二〇一九年八月二十九日