

**华夏网购精选灵活配置混合型
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：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。

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）.....	10
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.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录.....	47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华夏网购精选混合
基金主代码	002837
交易代码	002837
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 2 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	522,142,104.18 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金以网购消费大数据为基础构建量化投资策略，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金以网购消费大数据为基础构建量化投资策略，网购消费大数据指的是由蚂蚁金服提供的网上消费行业统计型趋势大数据，包括销售额存量长期增长、销售额长期增长、成交笔数长期增长、订单量存量长期增长、销售额存量同比、价格同比等数据。 本基金是灵活配置混合型基金，在资产配置策略和股票投资策略上均应用网购消费大数据，充分利用公司大数据研究平台的优势，分析研究网购消费大数据，力求为投资者把握网购消费大数据中的投资机会。
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率*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，低于股票基金，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	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
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

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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）
本期已实现收益	-7,943,499.79
本期利润	15,387,976.09
加权平均基金份额本期利润	0.1805
本期加权平均净值利润率	21.09%
本期基金份额净值增长率	11.27%
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	-92,453,738.65
期末可供分配基金份额利润	-0.1771
期末基金资产净值	453,819,744.75
期末基金份额净值	0.869
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	-13.10%

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	4.20%	1.02%	2.92%	0.83%	1.28%	0.19%
过去三个月	-1.59%	1.29%	5.40%	0.95%	-6.99%	0.34%
过去六个月	11.27%	1.17%	27.14%	0.92%	-15.87%	0.25%
过去一年	-5.44%	1.28%	16.20%	0.97%	-21.64%	0.31%
自基金合同生效起至今	-13.10%	0.97%	44.27%	0.78%	-57.37%	0.19%

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

华夏网购精选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 11 月 2 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		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2016-11-02	-	19 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理，上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 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（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、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（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 1

					月 13 日至 2017 年 11 月 10 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，在中美贸易摩擦、技术紧张局势加剧和英国脱欧不确定性长期持续的背景下，全球经济活动势头依旧疲弱。美国、日本等发达经济体增长表现超出预期，但新兴市场和发展中经济体的经济活动弱于预期。国内方面，在国内外形势比较复杂的情况下，经济增长保持了总体平稳、稳中有进的发展态势，主要宏观经济指标运行在合理区间，经济结构在优化调整。

市场方面，1 季度，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，推升市场反弹行情越走越高，各行业指数均录得正回报，估值低、弹性较大的中小盘风格指数补涨反弹最为强劲。2 季度，MSCI 提高 A 股因子由 5% 至 10%，借此机会北向资金加速流入 A 股进行布局，但由于中美贸易摩擦再起，上半年 A 股指数呈现先扬后抑的走势。

基金投资运作方面，作为灵活配置型基金，我们依据量化模型进行股票投资决策，还积极准备

科创板新股申购。

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 0.869 元，本报告期份额净值增长率为 11.27%，同期业绩比较基准增长率为 27.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，外部环境可能仍较复杂，国内经济还有下行压力，但经济平稳运行的基本面不会变，一系列逆周期调节的政策包括“六稳”政策逐步落地，效果将会继续显现，有利于实现全年经济社会发展的主要目标。

市场方面，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，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。

在投资运作方面，我们依然会根据现有模型结合市场状态，进行灵活操作。

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

本基金于 2019 年 2 月 19 日至 2019 年 5 月 19 日出现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网购精选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，华夏网购精选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网购精选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，华夏网购精选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网购精选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：华夏网购精选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	6.4.7.1	1,232,114.15	565,099.79
结算备付金		2,450,811.31	2,618,477.15
存出保证金		458,035.98	2,756.28
交易性金融资产	6.4.7.2	444,482,272.85	31,324,595.52
其中：股票投资		421,760,316.93	28,778,173.24
基金投资		-	-
债券投资		22,721,955.92	2,546,422.28
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	6,000,000.00	9,000,000.00
应收证券清算款		1,612.60	11,650.68
应收利息	6.4.7.5	142,095.20	72,035.79
应收股利		-	-
应收申购款		1,939.85	5,987.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		454,768,881.94	43,600,602.22
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		25,400.67	30,748.30
应付管理人报酬		237,474.04	56,209.21
应付托管费		39,578.99	9,368.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	599,959.75	315,348.46
应交税费		0.53	0.35
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	46,723.21	50,002.00
负债合计		949,137.19	461,676.50
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	522,142,104.18	55,252,099.44
未分配利润	6.4.7.10	-68,322,359.43	-12,113,173.72
所有者权益合计		453,819,744.75	43,138,925.72
负债和所有者权益总计		454,768,881.94	43,600,602.22

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.869 元，基金份额总额 522,142,104.18 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏网购精选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		16,458,780.96	-5,808,653.34
1.利息收入		173,332.30	111,793.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,166.83	61,625.40
债券利息收入		47,929.00	17,556.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		81,236.47	32,611.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,188,689.91	-1,718,127.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,368,693.71	-2,040,327.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-15.46	3,100.00
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	-	-191,318.37
股利收益	6.4.7.17	1,180,019.26	510,418.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	23,331,475.88	-4,216,867.83
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	142,662.69	14,548.42
减：二、费用		1,070,804.87	829,062.94
1.管理人报酬		524,689.17	486,818.03
2.托管费		87,448.21	81,136.39
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	391,482.30	175,598.53
5.利息支出		28.60	-
其中：卖出回购金融资产支出		28.60	-
6.税金及附加		0.27	435.44
7.其他费用	6.4.7.21	67,156.32	85,074.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,387,976.09	-6,637,716.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,387,976.09	-6,637,716.28

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏网购精选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）	55,252,099.44	-12,113,173.72	43,138,925.72

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,387,976.09	15,387,976.09
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)	466,890,004.74	-71,597,161.80	395,292,842.94
其中：1.基金申购款	496,585,161.04	-76,255,452.44	420,329,708.60
2.基金赎回款	-29,695,156.30	4,658,290.64	-25,036,865.66
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)	522,142,104.18	-68,322,359.43	453,819,744.75
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)	83,238,992.83	2,785,071.49	86,024,064.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,637,716.28	-6,637,716.28
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)	-25,565,465.17	-808,451.20	-26,373,916.37
其中：1.基金申购款	3,652,885.96	-28,238.20	3,624,647.76
2.基金赎回款	-29,218,351.13	-780,213.00	-29,998,564.13
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)	57,673,527.66	-4,661,095.99	53,012,431.67

报表附注为财务报表的组成部分。

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

华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1078号《关于准予华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投

资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2016 年 9 月 26 日至 2016 年 10 月 28 日共募集 466,130,728.47 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（16）第 0942 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 466,250,712.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 119,983.90 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工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《华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券、可转换债券）、货币市场工具（含同业存单）、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、期权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（但须符合中国证监会相关规定）。

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	1,232,114.15
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	1,232,114.15

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	407,938,044.38	421,760,316.93	13,822,272.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,445,882.00	2,441,955.92
	银行间市场	20,267,960.00	20,280,000.00
	合计	22,713,842.00	22,721,955.92
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	430,651,886.38	444,482,272.85	13,830,386.47

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,354,180.00	-	-	-
其中：股指期货	3,354,180.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,354,180.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1907	沪深 300 期货 IF1907 合约	2	2,283,000.00	67,320.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IF1908	沪深 300 期货 IF1908 合约	1	1,138,860.00	360.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					67,680.00
股指期货投资本期收益(元)					-
股指期货投资本期公允价值变动(元)					67,680.00

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

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-

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	3,156.00
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,150.19
应收债券利息	137,431.87

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	351.24
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5.90
合计	142,095.20

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	599,759.75
银行间市场应付交易费用	200.00
合计	599,959.75

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	19.86
预提费用	46,703.35
合计	46,723.21

6.4.7.9 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	55,252,099.44	55,252,099.44
本期申购	496,585,161.04	496,585,161.04
本期赎回（以“-”号填列）	-29,695,156.30	-29,695,156.30
本期末	522,142,104.18	522,142,104.18

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	-1,420,200.54	-10,692,973.18	-12,113,173.72
本期利润	-7,943,499.79	23,331,475.88	15,387,976.09
本期基金份额交易产生的	-83,090,038.32	11,492,876.52	-71,597,161.80

变动数			
其中：基金申购款	-88,467,792.15	12,212,339.71	-76,255,452.44
基金赎回款	5,377,753.83	-719,463.19	4,658,290.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-92,453,738.65	24,131,379.22	-68,322,359.43

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	17,623.84	
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	26,205.14	
其他	337.85	
合计	44,166.83	

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	41,933,410.43	
减：卖出股票成本总额	50,302,104.14	
买卖股票差价收入	-8,368,693.71	

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	2,634,525.06	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,539,950.00	
减：应收利息总额	94,590.52	
买卖债券差价收入	-15.46	

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	1,180,019.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,180,019.26

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	23,263,795.88
——股票投资	23,262,154.24
——债券投资	1,641.64
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	67,680.00
——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	23,331,475.88

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	142,662.69
合计	142,662.69

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	391,282.30
银行间市场交易费用	200.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	391,482.30

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	1,852.97
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	67,156.32

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
中信期货有限公司(“中信期货”)	基金管理人股东控股的公司

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	385,985,325.44	83.62%	54,304,825.57	43.07%

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1月1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	39,829.85	1.62%	-	-

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	150,200,000.00	21.34%	-	-

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	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

	佣金	总量的比例		总额的比例
中信证券	282,271.70	91.55%	282,271.70	91.55%
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	39,713.53	37.27%	1.46	0.00%

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	524,689.17	486,818.03
其中：支付销售机构的客户维护费	45,593.02	59,702.58

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 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	87,448.21	81,136.39

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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 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	1,232,114.15	17,623.84	3,090,620.08	20,091.52

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。

6.4.10.6 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

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 35,526,200.00 元(上年度可比期间:0 元)，支付给中信期货的佣金为 870.41 元（上年度可比期间为：0 元）。

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	-

6.4.12.2 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之内。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	1,232,114.15	-	-	1,232,114.15
结算备付金	2,450,811.31	-	-	2,450,811.31
结算保证金	13,194.18	-	-	13,194.18
债券投资	22,721,955.92	-	-	22,721,955.92
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	6,000,000.00
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	合计

2018 年 12 月 31 日				
银行存款	565,099.79	-	-	565,099.79
结算备付金	2,618,477.15	-	-	2,618,477.15
结算保证金	2,756.28	-	-	2,756.28
债券投资	2,546,422.28	-	-	2,546,422.28
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	9,000,000.00	-	-	9,000,000.00
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	46,890.20	1,640.46
	利率上升 25 个基点	-46,695.78	-1,637.82

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	421,760,316.93	92.94	28,778,173.24	66.71
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	421,760,316.93	92.94	28,778,173.24	66.71

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%	22,127,784.67	1,570,502.61
	-5%	-22,127,784.67	-1,570,502.61

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 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 46,695,637.59 元，第二层次的余额为 82,251.00 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 28,813,595.52 元，第二层次的余额为 2,511,000.00 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	421,760,316.93	92.74
	其中：股票	421,760,316.93	92.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,721,955.92	5.00
	其中：债券	22,721,955.92	5.00
	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	6,000,000.00	1.32
	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	3,682,925.46	0.81
8	其他各项资产	603,683.63	0.13
9	合计	454,768,881.94	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	6,284,525.00	1.38
B	采矿业	13,897,398.15	3.06
C	制造业	170,955,221.54	37.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,689,284.00	2.14
E	建筑业	12,955,634.00	2.85
F	批发和零售业	5,824,864.58	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	12,294,503.10	2.71
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,807,932.12	3.48
J	金融业	144,628,884.94	31.87
K	房地产业	18,717,465.00	4.12
L	租赁和商务服务业	5,745,267.00	1.27
M	科学研究和技术服务业	312,048.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	507,908.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,127,591.50	0.47
R	文化、体育和娱乐业	2,011,790.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	421,760,316.93	92.94

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	373,400	33,086,974.00	7.29
2	600519	贵州茅台	17,300	17,023,200.00	3.75
3	600036	招商银行	355,500	12,790,890.00	2.82
4	601166	兴业银行	501,200	9,166,948.00	2.02
5	000651	格力电器	165,900	9,124,500.00	2.01
6	601688	华泰证券	406,000	9,061,920.00	2.00
7	000333	美的集团	168,400	8,733,224.00	1.92
8	000858	五粮液	66,900	7,890,855.00	1.74
9	600276	恒瑞医药	106,700	7,042,200.00	1.55
10	600887	伊利股份	210,200	7,022,782.00	1.55
11	601328	交通银行	947,000	5,795,640.00	1.28
12	600016	民生银行	855,580	5,432,933.00	1.20
13	601288	农业银行	1,320,400	4,753,440.00	1.05
14	600000	浦发银行	404,700	4,726,896.00	1.04
15	000002	万科 A	167,600	4,660,956.00	1.03
16	300498	温氏股份	128,200	4,597,252.00	1.01
17	601668	中国建筑	723,440	4,159,780.00	0.92
18	000001	平安银行	295,900	4,077,502.00	0.90
19	600900	长江电力	227,500	4,072,250.00	0.90
20	600837	海通证券	278,900	3,957,591.00	0.87
21	601601	中国太保	108,300	3,954,033.00	0.87
22	002415	海康威视	128,900	3,555,062.00	0.78
23	600048	保利地产	246,000	3,138,960.00	0.69
24	600104	上汽集团	120,800	3,080,400.00	0.68
25	601169	北京银行	510,100	3,014,691.00	0.66
26	601888	中国国旅	33,600	2,978,640.00	0.66

27	603288	海天味业	27,900	2,929,500.00	0.65
28	600585	海螺水泥	68,900	2,859,350.00	0.63
29	601211	国泰君安	155,400	2,851,590.00	0.63
30	000725	京东方 A	817,000	2,810,480.00	0.62
31	600009	上海机场	33,200	2,781,496.00	0.61
32	601988	中国银行	726,400	2,716,736.00	0.60
33	601766	中国中车	335,400	2,713,386.00	0.60
34	000063	中兴通讯	82,000	2,667,460.00	0.59
35	600031	三一重工	202,100	2,643,468.00	0.58
36	002304	洋河股份	20,800	2,528,448.00	0.56
37	600028	中国石化	461,100	2,522,217.00	0.56
38	300059	东方财富	185,220	2,509,731.00	0.55
39	601088	中国神华	113,700	2,317,206.00	0.51
40	600309	万华化学	54,120	2,315,794.80	0.51
41	601229	上海银行	188,300	2,231,355.00	0.49
42	600690	青岛海尔	126,100	2,180,269.00	0.48
43	002142	宁波银行	89,800	2,176,752.00	0.48
44	002475	立讯精密	85,100	2,109,629.00	0.46
45	601818	光大银行	548,900	2,091,309.00	0.46
46	000568	泸州老窖	25,200	2,036,916.00	0.45
47	000338	潍柴动力	165,200	2,030,308.00	0.45
48	600340	华夏幸福	62,100	2,022,597.00	0.45
49	601012	隆基股份	87,410	2,020,045.10	0.45
50	600019	宝钢股份	307,100	1,996,150.00	0.44
51	600050	中国联通	321,000	1,977,360.00	0.44
52	601857	中国石油	279,000	1,919,520.00	0.42
53	002027	分众传媒	354,100	1,873,189.00	0.41
54	601989	中国重工	315,400	1,753,624.00	0.39
55	600919	江苏银行	238,700	1,732,962.00	0.38
56	601939	建设银行	231,500	1,722,360.00	0.38
57	001979	招商蛇口	81,700	1,707,530.00	0.38
58	601009	南京银行	204,600	1,689,996.00	0.37
59	002714	牧原股份	28,700	1,687,273.00	0.37
60	600999	招商证券	98,600	1,685,074.00	0.37
61	002230	科大讯飞	50,500	1,678,620.00	0.37
62	601390	中国中铁	256,900	1,674,988.00	0.37
63	601006	大秦铁路	205,000	1,658,450.00	0.37
64	600015	华夏银行	212,100	1,633,170.00	0.36
65	601628	中国人寿	57,400	1,625,568.00	0.36
66	000661	长春高新	4,700	1,588,600.00	0.35
67	601336	新华保险	28,800	1,584,864.00	0.35
68	002594	比亚迪	31,200	1,582,464.00	0.35
69	601186	中国铁建	158,600	1,578,070.00	0.35

70	601899	紫金矿业	417,300	1,573,221.00	0.35
71	000166	申万宏源	310,700	1,556,607.00	0.34
72	600570	恒生电子	22,100	1,506,115.00	0.33
73	000538	云南白药	17,900	1,493,218.00	0.33
74	002024	苏宁易购	128,400	1,474,032.00	0.32
75	600352	浙江龙盛	89,700	1,414,569.00	0.31
76	000776	广发证券	102,000	1,401,480.00	0.31
77	601669	中国电建	263,700	1,394,973.00	0.31
78	601933	永辉超市	131,978	1,347,495.38	0.30
79	300015	爱尔眼科	42,750	1,323,967.50	0.29
80	600958	东方证券	123,400	1,317,912.00	0.29
81	601225	陕西煤业	137,900	1,274,196.00	0.28
82	000876	新希望	72,700	1,262,799.00	0.28
83	000100	TCL 集团	373,600	1,244,088.00	0.27
84	601155	新城控股	31,100	1,238,091.00	0.27
85	300142	沃森生物	42,400	1,202,464.00	0.26
86	600436	片仔癀	10,400	1,198,080.00	0.26
87	600406	国电南瑞	63,700	1,187,368.00	0.26
88	002202	金风科技	95,200	1,183,336.00	0.26
89	600741	华域汽车	54,300	1,172,880.00	0.26
90	600588	用友网络	42,800	1,150,464.00	0.25
91	002736	国信证券	84,800	1,115,968.00	0.25
92	600660	福耀玻璃	48,300	1,097,859.00	0.24
93	601377	兴业证券	161,600	1,089,184.00	0.24
94	000157	中联重科	177,000	1,063,770.00	0.23
95	600010	包钢股份	628,500	1,062,165.00	0.23
96	600547	山东黄金	25,600	1,053,952.00	0.23
97	000783	长江证券	133,400	1,041,854.00	0.23
98	600795	国电电力	406,400	1,032,256.00	0.23
99	002008	大族激光	29,400	1,010,772.00	0.22
100	601901	方正证券	141,900	1,008,909.00	0.22
101	600705	中航资本	185,600	1,005,952.00	0.22
102	601111	中国国航	103,000	985,710.00	0.22
103	000069	华侨城 A	141,400	982,730.00	0.22
104	603993	洛阳钼业	243,600	964,656.00	0.21
105	600111	北方稀土	75,100	964,284.00	0.21
106	600703	三安光电	84,300	950,904.00	0.21
107	601108	财通证券	86,600	950,868.00	0.21
108	600011	华能国际	151,600	944,468.00	0.21
109	600438	通威股份	66,900	940,614.00	0.21
110	600383	金地集团	77,800	928,154.00	0.20
111	600089	特变电工	128,000	928,000.00	0.20
112	601800	中国交建	81,000	916,920.00	0.20

113	600029	南方航空	118,600	915,592.00	0.20
114	600886	国投电力	116,900	908,313.00	0.20
115	002236	大华股份	62,000	900,240.00	0.20
116	601985	中国核电	160,900	894,604.00	0.20
117	600271	航天信息	38,500	887,425.00	0.20
118	002422	科伦药业	29,800	885,954.00	0.20
119	002007	华兰生物	29,000	884,210.00	0.19
120	601600	中国铝业	225,400	883,568.00	0.19
121	600196	复星医药	34,700	877,910.00	0.19
122	600606	绿地控股	125,800	859,214.00	0.19
123	002001	新和成	44,400	856,476.00	0.19
124	000895	双汇发展	34,100	848,749.00	0.19
125	600115	东方航空	135,200	847,704.00	0.19
126	601555	东吴证券	82,700	847,675.00	0.19
127	300003	乐普医疗	36,800	847,136.00	0.19
128	002311	海大集团	27,300	843,570.00	0.19
129	600061	国投资本	58,300	816,783.00	0.18
130	600109	国金证券	83,400	810,648.00	0.18
131	002044	美年健康	64,600	803,624.00	0.18
132	600332	白云山	19,400	794,818.00	0.18
133	300124	汇川技术	34,400	788,104.00	0.17
134	000963	华东医药	30,120	781,915.20	0.17
135	000413	东旭光电	151,100	776,654.00	0.17
136	600522	中天科技	84,500	774,865.00	0.17
137	600487	亨通光电	45,900	769,284.00	0.17
138	601788	光大证券	67,300	768,566.00	0.17
139	600177	雅戈尔	121,000	768,350.00	0.17
140	002410	广联达	23,300	766,337.00	0.17
141	600018	上港集团	111,800	762,476.00	0.17
142	603019	中科曙光	21,700	761,670.00	0.17
143	000768	中航飞机	47,700	751,275.00	0.17
144	600637	东方明珠	71,000	748,340.00	0.16
145	601618	中国中冶	246,100	748,144.00	0.16
146	600100	同方股份	81,700	739,385.00	0.16
147	300033	同花顺	7,400	727,864.00	0.16
148	002352	顺丰控股	21,300	723,348.00	0.16
149	300017	网宿科技	67,100	723,338.00	0.16
150	000425	徐工机械	162,000	722,520.00	0.16
151	601607	上海医药	39,800	722,370.00	0.16
152	300122	智飞生物	16,500	711,150.00	0.16
153	600893	航发动力	31,000	704,010.00	0.16
154	300408	三环集团	36,000	700,200.00	0.15
155	002271	东方雨虹	30,900	700,194.00	0.15

156	600176	中国巨石	72,400	689,972.00	0.15
157	601877	正泰电器	29,700	685,773.00	0.15
158	600516	方大炭素	55,726	684,872.54	0.15
159	600498	烽火通信	24,200	674,212.00	0.15
160	601919	中远海控	133,400	669,668.00	0.15
161	300136	信维通信	26,900	657,705.00	0.14
162	601727	上海电气	121,500	653,670.00	0.14
163	600004	白云机场	35,700	649,740.00	0.14
164	600867	通化东宝	42,100	648,340.00	0.14
165	000728	国元证券	69,600	638,232.00	0.14
166	002460	赣锋锂业	26,900	630,267.00	0.14
167	000423	东阿阿胶	15,800	629,156.00	0.14
168	600023	浙能电力	140,600	621,452.00	0.14
169	600809	山西汾酒	9,000	621,450.00	0.14
170	600489	中金黄金	59,500	611,065.00	0.13
171	002673	西部证券	60,300	607,824.00	0.13
172	601018	宁波港	136,200	597,918.00	0.13
173	002466	天齐锂业	23,600	596,608.00	0.13
174	002241	歌尔股份	67,100	596,519.00	0.13
175	600066	宇通客车	45,800	596,316.00	0.13
176	600068	葛洲坝	95,200	593,096.00	0.13
177	002179	中航光电	17,700	592,242.00	0.13
178	600926	杭州银行	70,700	588,931.00	0.13
179	300144	宋城演艺	25,000	578,500.00	0.13
180	600170	上海建工	153,500	577,160.00	0.13
181	601997	贵阳银行	66,600	576,090.00	0.13
182	300024	机器人	37,600	572,648.00	0.13
183	002081	金螳螂	55,300	570,143.00	0.13
184	601021	春秋航空	12,600	567,000.00	0.12
185	601198	东兴证券	47,500	564,300.00	0.12
186	600362	江西铜业	35,800	563,492.00	0.12
187	002146	荣盛发展	59,900	562,461.00	0.12
188	600398	海澜之家	61,900	561,433.00	0.12
189	600482	中国动力	23,700	559,794.00	0.12
190	600219	南山铝业	247,100	558,446.00	0.12
191	002602	世纪华通	51,100	558,012.00	0.12
192	000961	中南建设	63,900	553,374.00	0.12
193	601838	成都银行	62,300	550,109.00	0.12
194	600085	同仁堂	18,900	548,100.00	0.12
195	601881	中国银河	44,400	543,900.00	0.12
196	600674	川投能源	60,700	540,230.00	0.12
197	603156	养元饮品	14,500	537,660.00	0.12
198	000630	铜陵有色	217,700	535,542.00	0.12

199	000703	恒逸石化	39,200	535,472.00	0.12
200	002739	万达电影	28,700	529,228.00	0.12
201	000786	北新建材	29,100	527,583.00	0.12
202	002493	荣盛石化	43,400	523,404.00	0.12
203	600535	天士力	31,300	518,015.00	0.11
204	002456	欧菲光	65,500	513,520.00	0.11
205	603986	兆易创新	5,900	511,530.00	0.11
206	300070	碧水源	65,200	507,908.00	0.11
207	002050	三花智控	47,700	503,235.00	0.11
208	600297	广汇汽车	112,800	503,088.00	0.11
209	000629	攀钢钒钛	148,000	501,720.00	0.11
210	002555	三七互娱	36,600	495,930.00	0.11
211	601138	工业富联	41,000	494,050.00	0.11
212	300296	利亚德	61,400	480,762.00	0.11
213	600369	西南证券	97,300	480,662.00	0.11
214	603799	华友钴业	22,300	475,213.00	0.10
215	000596	古井贡酒	4,000	474,040.00	0.10
216	600663	陆家嘴	30,300	469,650.00	0.10
217	002624	完美世界	18,100	467,161.00	0.10
218	600208	新湖中宝	148,200	465,348.00	0.10
219	603833	欧派家居	4,300	462,766.00	0.10
220	600118	中国卫星	20,400	460,020.00	0.10
221	002065	东华软件	64,400	450,156.00	0.10
222	000625	长安汽车	67,200	445,536.00	0.10
223	002508	老板电器	16,400	445,096.00	0.10
224	600346	恒力石化	36,540	444,326.40	0.10
225	000656	金科股份	73,600	443,808.00	0.10
226	000627	天茂集团	68,100	441,969.00	0.10
227	000709	河钢股份	146,400	437,736.00	0.10
228	600153	建发股份	48,900	434,232.00	0.10
229	601992	金隅集团	115,000	432,400.00	0.10
230	002032	苏泊尔	5,700	432,231.00	0.10
231	603160	汇顶科技	3,100	430,280.00	0.09
232	601878	浙商证券	46,000	427,800.00	0.09
233	600583	海油工程	76,200	426,720.00	0.09
234	600027	华电国际	112,300	423,371.00	0.09
235	600760	中航沈飞	14,500	420,935.00	0.09
236	600038	中直股份	10,200	418,404.00	0.09
237	601117	中国化学	68,000	409,360.00	0.09
238	600977	中国电影	25,700	402,462.00	0.09
239	002153	石基信息	11,000	398,090.00	0.09
240	603858	步长制药	15,300	394,281.00	0.09
241	600688	上海石化	75,800	391,128.00	0.09

242	600415	小商品城	93,800	386,456.00	0.09
243	601216	君正集团	116,300	382,627.00	0.08
244	002558	巨人网络	20,900	379,753.00	0.08
245	600816	安信信托	72,000	363,600.00	0.08
246	000671	阳光城	55,800	361,584.00	0.08
247	002252	上海莱士	51,400	357,230.00	0.08
248	601238	广汽集团	32,000	349,760.00	0.08
249	601319	中国人保	36,700	348,283.00	0.08
250	601633	长城汽车	41,600	344,032.00	0.08
251	002010	传化智联	44,900	338,097.00	0.07
252	600566	济川药业	11,200	337,232.00	0.07
253	002310	东方园林	55,500	333,000.00	0.07
254	600188	兖州煤业	30,600	332,622.00	0.07
255	000402	金融街	41,200	323,008.00	0.07
256	002294	信立泰	14,400	322,272.00	0.07
257	600704	物产中大	59,400	321,948.00	0.07
258	300168	万达信息	24,800	321,656.00	0.07
259	300072	三聚环保	40,500	321,165.00	0.07
260	000898	鞍钢股份	82,680	313,357.20	0.07
261	603259	药明康德	3,600	312,048.00	0.07
262	601066	中信建投	14,800	311,984.00	0.07
263	002601	龙蟠佰利	21,000	311,430.00	0.07
264	002120	韵达股份	9,955	306,813.10	0.07
265	601898	中煤能源	63,100	302,880.00	0.07
266	002773	康弘药业	9,100	299,572.00	0.07
267	601360	三六零	14,000	299,320.00	0.07
268	300413	芒果超媒	7,200	295,560.00	0.07
269	002411	延安必康	15,800	274,920.00	0.06
270	600372	中航电子	18,200	270,088.00	0.06
271	000938	紫光股份	9,900	269,775.00	0.06
272	601228	广州港	64,000	267,520.00	0.06
273	002468	申通快递	10,600	264,364.00	0.06
274	002938	鹏鼎控股	8,800	258,368.00	0.06
275	600025	华能水电	62,000	252,340.00	0.06
276	600339	中油工程	57,700	243,494.00	0.05
277	600998	九州通	19,400	239,784.00	0.05
278	300251	光线传媒	30,300	206,040.00	0.05
279	002939	长城证券	11,800	196,942.00	0.04
280	601808	中海油服	20,400	196,452.00	0.04
281	601162	天风证券	17,900	194,036.00	0.04
282	300433	蓝思科技	27,100	188,887.00	0.04
283	002925	盈趣科技	4,700	183,347.00	0.04
284	002945	华林证券	9,300	172,050.00	0.04

285	600390	五矿资本	18,100	170,683.00	0.04
286	000408	藏格控股	20,600	170,362.00	0.04
287	601828	美凯龙	13,900	168,885.00	0.04
288	000553	安道麦 A	15,700	168,304.00	0.04
289	603260	合盛硅业	3,500	164,710.00	0.04
290	600233	圆通速递	12,700	156,591.00	0.03
291	601298	青岛港	16,700	140,113.00	0.03
292	002625	光启技术	14,900	138,421.00	0.03
293	601212	白银有色	29,800	130,822.00	0.03
294	601577	长沙银行	13,000	124,020.00	0.03
295	600733	北汽蓝谷	14,500	119,770.00	0.03
296	600299	安迪苏	10,200	105,774.00	0.02
297	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
298	300782	卓胜微	297	32,349.24	0.01
299	600968	海油发展	7,993	28,375.15	0.01
300	603867	新化股份	870	22,454.70	0.00
301	601698	中国卫通	5,186	20,329.12	0.00
302	300594	朗进科技	396	17,467.56	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	601318	中国平安	30,873,232.00	71.57
2	600519	贵州茅台	15,395,356.00	35.69
3	600036	招商银行	13,279,875.00	30.78
4	601166	兴业银行	8,954,775.00	20.76
5	000333	美的集团	8,816,409.00	20.44
6	000651	格力电器	8,683,186.00	20.13
7	601688	华泰证券	8,523,803.00	19.76
8	000858	五粮液	7,137,665.92	16.55
9	600887	伊利股份	6,752,270.00	15.65
10	600276	恒瑞医药	6,704,729.18	15.54
11	601328	交通银行	5,725,763.00	13.27
12	600016	民生银行	5,560,167.00	12.89
13	601288	农业银行	5,326,842.00	12.35
14	600000	浦发银行	5,006,279.35	11.61
15	300498	温氏股份	4,904,536.00	11.37
16	000002	万科 A	4,658,624.00	10.80
17	601668	中国建筑	4,470,090.60	10.36
18	600900	长江电力	4,043,677.00	9.37
19	000001	平安银行	3,888,307.59	9.01

20	601601	中国太保	3,836,715.00	8.89
21	600837	海通证券	3,517,681.86	8.15
22	600048	保利地产	3,429,652.45	7.95
23	002415	海康威视	3,412,250.00	7.91
24	600104	上汽集团	3,117,354.00	7.23
25	601169	北京银行	3,081,906.00	7.14
26	603288	海天味业	2,825,779.00	6.55
27	000725	京东方 A	2,779,166.00	6.44
28	601988	中国银行	2,777,327.00	6.44
29	600585	海螺水泥	2,758,004.00	6.39
30	601766	中国中车	2,754,444.00	6.39
31	300059	东方财富	2,750,091.97	6.37
32	601888	中国国旅	2,735,069.21	6.34
33	600031	三一重工	2,619,072.58	6.07
34	601211	国泰君安	2,577,526.00	5.97
35	600009	上海机场	2,543,356.00	5.90
36	600028	中国石化	2,505,442.00	5.81
37	601229	上海银行	2,434,509.00	5.64
38	000063	中兴通讯	2,412,859.00	5.59
39	002304	洋河股份	2,411,112.00	5.59
40	601818	光大银行	2,401,341.00	5.57
41	601088	中国神华	2,278,999.00	5.28
42	601857	中国石油	2,138,702.00	4.96
43	600309	万华化学	2,119,658.00	4.91
44	600050	中国联通	2,106,893.00	4.88
45	600019	宝钢股份	2,091,794.00	4.85
46	002142	宁波银行	2,088,516.00	4.84
47	000338	潍柴动力	2,033,577.00	4.71
48	600690	海尔智家	2,032,254.00	4.71
49	601012	隆基股份	2,020,357.14	4.68
50	601939	建设银行	1,973,398.00	4.57
51	600340	华夏幸福	1,956,481.73	4.54
52	002475	立讯精密	1,955,372.00	4.53
53	002027	分众传媒	1,935,658.00	4.49
54	601390	中国中铁	1,840,682.51	4.27
55	000568	泸州老窖	1,797,662.00	4.17
56	002714	牧原股份	1,792,887.00	4.16
57	601989	中国重工	1,759,893.00	4.08
58	600919	江苏银行	1,736,261.00	4.02
59	601009	南京银行	1,718,290.00	3.98
60	001979	招商蛇口	1,695,235.00	3.93
61	600015	华夏银行	1,626,747.46	3.77
62	601006	大秦铁路	1,625,586.00	3.77

63	601336	新华保险	1,592,558.00	3.69
64	601628	中国人寿	1,580,332.00	3.66
65	600999	招商证券	1,575,467.00	3.65
66	002230	科大讯飞	1,573,673.00	3.65
67	002594	比亚迪	1,550,731.00	3.59
68	000166	申万宏源	1,532,833.00	3.55
69	600570	恒生电子	1,465,415.00	3.40
70	000661	长春高新	1,452,041.00	3.37
71	601899	紫金矿业	1,451,874.00	3.37
72	002024	苏宁易购	1,413,014.00	3.28
73	300124	汇川技术	1,407,440.00	3.26
74	000876	新希望	1,396,185.00	3.24
75	000538	云南白药	1,395,289.00	3.23
76	601669	中国电建	1,391,335.00	3.23
77	600352	浙江龙盛	1,385,346.00	3.21
78	601933	永辉超市	1,344,318.90	3.12
79	000776	广发证券	1,334,986.00	3.09
80	601186	中国铁建	1,324,129.00	3.07
81	600958	东方证券	1,283,691.00	2.98
82	601225	陕西煤业	1,243,984.00	2.88
83	601155	新城控股	1,223,111.00	2.84
84	600547	山东黄金	1,214,913.00	2.82
85	000100	TCL 集团	1,210,862.00	2.81
86	300015	爱尔眼科	1,168,059.00	2.71
87	600406	国电南瑞	1,150,262.62	2.67
88	600436	片仔癀	1,143,614.00	2.65
89	600741	华域汽车	1,123,757.00	2.60
90	600010	包钢股份	1,080,504.00	2.50
91	600588	用友网络	1,071,692.00	2.48
92	002202	金风科技	1,071,266.00	2.48
93	600703	三安光电	1,059,740.00	2.46
94	600660	福耀玻璃	1,046,469.00	2.43
95	600795	国电电力	1,045,602.00	2.42
96	002736	国信证券	1,032,712.00	2.39
97	601377	兴业证券	1,025,160.00	2.38
98	002008	大族激光	1,023,753.00	2.37
99	000157	中联重科	1,017,941.00	2.36
100	600011	华能国际	1,013,206.00	2.35
101	603993	洛阳钼业	1,007,392.00	2.34
102	300142	沃森生物	1,002,914.00	2.32
103	600705	中航资本	996,235.00	2.31
104	601901	方正证券	991,605.00	2.30
105	000069	华侨城 A	989,870.00	2.29

106	600111	北方稀土	987,284.00	2.29
107	000783	长江证券	973,050.00	2.26
108	601800	中国交建	970,745.00	2.25
109	601108	财通证券	968,939.00	2.25
110	600438	通威股份	956,903.00	2.22
111	601111	中国国航	951,765.00	2.21
112	600886	国投电力	938,185.00	2.17
113	600383	金地集团	926,424.00	2.15
114	600089	特变电工	918,288.76	2.13
115	300003	乐普医疗	893,766.00	2.07
116	601985	中国核电	889,179.33	2.06
117	600271	航天信息	888,609.00	2.06
118	601600	中国铝业	883,429.00	2.05
119	002001	新和成	878,216.00	2.04

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	300124	汇川技术	761,813.00	1.77
2	600016	民生银行	685,307.00	1.59
3	600036	招商银行	651,655.98	1.51
4	601318	中国平安	646,530.00	1.50
5	000651	格力电器	617,501.48	1.43
6	600837	海通证券	575,645.00	1.33
7	600887	伊利股份	565,037.00	1.31
8	600048	保利地产	556,320.00	1.29
9	601288	农业银行	530,440.00	1.23
10	600000	浦发银行	506,368.00	1.17
11	600519	贵州茅台	495,680.00	1.15
12	601012	隆基股份	495,643.40	1.15
13	300347	泰格医药	486,204.00	1.13
14	601668	中国建筑	476,736.00	1.11
15	000671	阳光城	449,176.00	1.04
16	601688	华泰证券	432,590.00	1.00
17	300012	华测检测	424,267.00	0.98
18	300014	亿纬锂能	413,834.00	0.96
19	600547	山东黄金	409,817.00	0.95
20	300253	卫宁健康	403,267.00	0.93

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	420,022,093.59
卖出股票的收入（成交）总额	41,933,410.43

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	2,408,072.00	0.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,280,000.00	4.47
	其中：政策性金融债	20,280,000.00	4.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	33,883.92	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,721,955.92	5.01

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	170307	17 进出 07	200,000	20,280,000.00	4.47
2	019611	19 国债 01	24,100	2,408,072.00	0.53
3	123022	长信转债	332	33,883.92	0.01
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1907	沪深 300 期货 IF1907 合约	2	2,283,000.00	67,320.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理, 实现投资目标。
IF1908	沪深 300 期货 IF1908 合约	1	1,138,860.00	360.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理, 实现投资目标。
公允价值变动总额合计					67,680.00
股指期货投资本期收益					-
股指期货投资本期公允价值变动					67,680.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在风险可控的前提下, 根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要, 更有效地进行流动性管理, 实现投资目标。

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	458,035.98
2	应收证券清算款	1,612.60
3	应收股利	-

4	应收利息	142,095.20
5	应收申购款	1,939.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	603,683.63

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
6,757	77,274.25	472,252,656.44	90.45%	49,889,447.74	9.55%

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	635,836.89	0.12%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 11 月 2 日）基金份额总额	466,250,712.37
本报告期期初基金份额总额	55,252,099.44
本报告期基金总申购份额	496,585,161.04
减：本报告期基金总赎回份额	29,695,156.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	522,142,104.18

§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	385,985,325.44	83.62%	282,271.70	91.55%	-
中国银河证券	1	-	-	-	0.00%	-

长城证券	1	-	-	-	0.00%	-
长江证券	1	-	-	-	0.00%	-
国金证券	1	48,704,513.96	10.55%	6,395.32	2.07%	-
齐鲁证券	1	14,600,799.98	3.16%	10,677.73	3.46%	-
方正证券	1	12,279,162.62	2.66%	8,979.88	2.91%	-

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，本基金还选择联讯证券、东方证券、国金证券、国泰君安证券、中银国际证券、中信建投证券、上海证券、中金公司、中投证券、中泰证券、长江证券、新时代证券、天风证券、兴业证券、方正证券和信达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，联讯证券、长城证券、东方证券和中金公司的部分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	39,829.85	1.62%	150,200,000.00	21.34%
中国银河证券	-	-	129,000,000.00	18.33%
长城证券	2,412,682.00	98.37%	25,800,000.00	3.67%

长江证券	-	-	367,000,000.00	52.14%
国金证券	-	-	31,900,000.00	4.53%
齐鲁证券	195.21	0.01%	-	-
方正证券	-	-	-	-

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旗下部分开放式基金新增上海天天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	2019-01-03
2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-02
3	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增华融湘江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	2019-03-04
4	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外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
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增玄元保险代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	2019-05-09
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在嘉实财富管理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	2019-05-13
7	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

§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	2019-06-19 至 2019-06-30	-	236,126,328.22	-	236,126,328.22	45.22%
	2	2019-06-19 至 2019-06-30	-	236,126,328.22	-	236,126,328.22	45.22%
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注册的文件；

12.1.2 《华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏网购精选灵活配置混合型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