

# 華夏興華混合型證券投資基金

## 2016 年半年度報告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：華夏基金管理有限公司

基金託管人：中國建設銀行股份有限公司

報告送出日期：二〇一六年八月二十七日

華夏興華混合型證券投資基金(“**本基金**”)

2016 年半年度報告

向香港投資者提供的資料

本基金是根據香港《證券及期貨條例》(「**證券及期貨條例**」) 第 104 條在香港獲得證券及期貨事務監察委員會(「**證監會**」) 認可。證監會認可不代表對本基金的推薦或認許，亦不代表其對本基金的商業利弊或其表現作出保證。此並不意指本基金適合所有投資者，亦並非認許本基金適合任何特定投資者或投資者類別。

本基金只有 **H** 類別份額可供香港投資者認購。

補充披露部分只編備以供在香港派發。補充披露部分載有本基金投資組合的額外詳情，其必須連同本基金的 2016 年半年度報告一併閱覽。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

二〇一六年八月二十七日

---

## §1 重要提示及目錄

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事會、董事保證本報告所載資料不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並對其內容的真實性、準確性及完整性承擔個別及連帶的法律責任。本半年度報告已經三分之二以上獨立董事簽字同意，並由董事長簽發。

基金託管人中國建設銀行股份有限公司根據本基金合同規定，於 2016 年 8 月 25 日覆核了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證覆核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

基金管理人承諾以誠實信用、勤勉盡責的原則管理及運用基金資產，但不保證基金一定盈利。

基金的過往業績並不代表其未來表現。投資有風險，投資者在作出投資決策前應仔細閱讀本基金的招募說明書及其更新。

本報告中財務資料未經審計。

本報告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目錄

§1 重要提示及目錄.....	1
§2 基金簡介 .....	3
§3 主要財務指標及基金淨值表現.....	4
3.1 主要會計資料及財務指標.....	4
3.2 基金淨值表現.....	5
§4 管理人報告 .....	6
§5 託管人報告 .....	11
§6 半年度財務會計報告（未經審計） .....	12
6.1 資產負債表.....	12
6.2 利潤表 .....	13
6.3 所有者權益（基金淨值）變動表.....	14
6.4 報表附注.....	15
§7 投資組合報告.....	34
7.1 期末基金資產組合情況.....	34
7.2 期末按行業分類的股票投資組合.....	35
7.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資詳情.....	35
7.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	37
7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合.....	39
7.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有債券投資詳情.....	39
7.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資詳情.....	40
7.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資詳情.....	40
7.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資詳情.....	40
7.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明.....	40
7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明.....	40
7.12 投資組合報告附注.....	40
§8 基金份額持有人資訊.....	41
8.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構.....	41
8.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況.....	42
8.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況.....	42
§9 開放式基金份額變動.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
§11 備查文件目錄.....	45
§12 補充披露 .....	47

## §2 基金簡介

### 2.1 基金基本情況

基金名稱	華夏興華混合型證券投資基金
基金簡稱	華夏興華混合
基金主代碼	519908
交易代碼	519908
基金運作方式	契約型開放式
基金合同生效日	2013年4月12日
基金管理人	華夏基金管理有限公司
基金託管人	中國建設銀行股份有限公司
報告期末基金份額總額	734,268,811.63份
基金合同存續期	不定期

### 2.2 基金產品說明

投資目標	密切跟蹤經濟動向，挖掘中國經濟發展過程中所蘊含的機會，更好地分享中國經濟較快成長的發展成果，力爭實現基金資產的長期、持續增值。
投資策略	本基金通過對宏觀經濟環境、政策形勢、證券市場走勢的綜合分析，主動判斷市場時機，進行積極的資產配置，合理確定基金在股票、債券等各類資產類別上的投資比例，並隨著各類資產風險收益特徵的相對變化，適時進行動態調整。
業績比較基準	本基金的業績比較基準為：滬深 300 指數×70% + 上證國債指數×30%。
風險收益特徵	本基金為混合基金，風險與收益高於債券基金與貨幣市場基金，低於股票基金，屬於較高風險、較高收益的品種。

### 2.3 基金管理人及基金託管人

項目		基金管理人	基金託管人
名稱		華夏基金管理有限公司	中國建設銀行股份有限公司
信息披露 負責人	姓名	張靜	田青
	聯繫電話	400-818-6666	010-67595096
	電子郵箱	<a href="mailto:service@ChinaAMC.com">service@ChinaAMC.com</a>	<a href="mailto:tianqing1.zh@ccb.com">tianqing1.zh@ccb.com</a>
客戶服務電話		400-818-6666	010-67595096
傳真		010-63136700	010-66275853
註冊地址		北京市順義區天竺空港工業區 A 區	北京市西城區金融大街 25 號

辦公地址	北京市西城區金融大街 33 號通泰大廈 B 座 8 層	北京市西城區鬧市口大街 1 號院 1 號樓
郵遞區號	100033	100033
法定代表人	楊明輝	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金選定的信息披露報紙名稱	《上海證券報》
登載基金半年度報告正文的管理人互聯網網址	<a href="http://www.ChinaAMC.com">www.ChinaAMC.com</a>
基金半年度報告備置地地點	基金管理人及基金託管人的住所

## 2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
註冊登記機構	中國證券登記結算有限責任公司	北京市西城區太平橋大街 17 號

## §3 主要財務指標及基金淨值表現

### 3.1 主要會計資料及財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間資料及指標	報告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已實現收益	-190,006,434.11
本期利潤	-191,637,164.93
加權平均基金份額本期利潤	-0.2452
本期加權平均淨值利潤率	-15.25%
本期基金份額淨值增長率	-12.47%
3.1.2 期末資料及指標	報告期末（2016 年 6 月 30 日）
期末可供分配利潤	524,336,733.74
期末可供分配基金份額利潤	0.7141
期末基金資產淨值	1,222,022,096.43
期末基金份額淨值	1.664
3.1.3 累計期末指標	報告期末（2016 年 6 月 30 日）
基金份額累計淨值增長率	77.79%

注：①所述基金業績指標不包括持有人認購或交易基金的各項費用，計入費用後實際收益水準要低於所列數字。

②本期已實現收益指基金本期利息收入、投資收益、其他收入（不含公允價值變動收益）扣除相關費用後的餘額，本期利潤為本期已實現收益加上本期公允價值變動收益。

③期末可供分配利潤為期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現部分的孰低數。

### 3.2 基金淨值表現

#### 3.2.1 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

階段	份額淨值增長率①	份額淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①-③	②-④
過去一個月	2.65%	1.23%	-0.23%	0.69%	2.88%	0.54%
過去三個月	-1.19%	1.46%	-1.14%	0.71%	-0.05%	0.75%
過去六個月	-12.47%	2.35%	-10.16%	1.29%	-2.31%	1.06%
過去一年	-15.70%	2.91%	-19.34%	1.61%	3.64%	1.30%
過去三年	73.33%	2.05%	37.45%	1.29%	35.88%	0.76%
自基金合同生效起至今	77.79%	2.01%	26.93%	1.27%	50.86%	0.74%

#### 3.2.2 自基金轉型以來基金份額累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較

##### 華夏興華混合型證券投資基金

##### 份額累計淨值增長率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖

(2013 年 4 月 12 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：自 2013 年 4 月 12 日起，由《興華證券投資基金基金合同》修訂而成的《華夏興

華混合型證券投資基金基金合同》生效。

## §4 管理人報告

### 4.1 基金管理人及基金經理情況

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的經驗

華夏基金管理有限公司成立於 1998 年 4 月 9 日，是經中國證監會批准成立的首批全國性基金管理公司之一。公司總部設在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、廣州及青島設有分公司，在香港、深圳、上海設有子公司。公司是首批全國社保基金管理人、首批企業年金基金管理人、境內首批 QDII 基金管理人、境內首隻 ETF 基金管理人、境內首隻滬港通 ETF 基金管理人、首批內地與香港基金互認基金管理人，以及特定客戶資產管理人、保險資金投資管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。華夏基金是業務領域最廣泛的基金管理公司之一。

華夏基金以深入的投資研究為基礎，盡力捕捉市場機會，為投資人謀求良好的回報。根據銀河證券基金研究中心基金業績統計報告，在基金分類排名中（截至 2016 年 6 月 30 日資料），華夏策略混合在 75 隻靈活配置混合型基金（股票上限 80%）中排名第 8，華夏滬深 300 指數增強 A 在 39 隻增強指數股票型基金中排名第 11；固定收益類產品中，華夏理財 30 天債券在 41 隻短期理財債券型基金中排名第 9，華夏薪金寶貨幣在 194 隻貨幣型基金中排名第 13。

在《中國證券報》主辦的第十三屆中國基金業金牛獎的評選中，華夏基金獲得“2015 年度被動投資金牛基金公司”獎。在《上海證券報》主辦的第十三屆中國“金基金”獎評選中，華夏基金獲得“2015 年度金基金·債券投資回報基金管理公司”獎。



在客戶服務方面，華夏基金繼續以客戶需求為導向，努力提高客戶使用的便利性及服務體驗：（1）實現資產證明及對帳單自動獲取，客戶可以自助提交申請並查詢辦理進度，業務處理更加高效；（2）網上交易平台上線交通銀行、招商銀行、民生銀行、郵政儲蓄銀行等快捷支付方式及華夏財富系統，並與滴滴出行合作推出滴滴金桔寶理財，拓寬客戶交易通道，增加交易便利性；（3）開展“130 萬人定投的華夏紅利”、“客戶個性化白皮書”、“你定，我投”、“書寫華夏印象，見證一個行業”等活動，為客戶提供多樣化的關懷服務。

#### 4.1.2 基金經理（或基金經理小組）及基金經理助理簡介

姓名	職務	任本基金的基金經理期限		證券從業年限	說明
		任職日期	離任日期		
陽琨	本基金的基金經理、公司副總經理、投資總監	2013-04-12	-	21 年	北京大學 MBA。曾任寶盈基金基金經理助理，益民基金投資部部門經理，中國對外經濟貿易信託投資有限公司財務部部門經理等。2006 年 8 月加入華夏基金管理有限公，曾任策略研究員、股票投資部副總經理，興和證券投資基金基金經理（2009 年 1 月 1 日至 2012 年 1 月 12 日期間）、興華證券投資基金基金經理（2007 年 6 月 12 日至 2013 年 4 月 11 日期間）、華夏盛世精選混合型證券投資基金基金經理（2009 年 12 月 18 日至 2015 年 9 月 1 日期間）等。

注：①上述任職日期、離任日期根據本基金管理人對外披露的任免日期填寫。

②證券從業的含義遵從行業協會《證券業從業人員資格管理辦法》的相關規定。

#### 4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明

報告期內，本基金管理人嚴格遵守《中華人民共和國證券投資基金法》、《公開募集證券投資基金運作管理辦法》、《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》、《基金管理公司開展投資、研究活動防控內幕交易指導意見》、基金合同及其他有關法律法規，本著誠實信用、勤勉盡責、安全高效的原則管理及運用基金資產，在嚴格控制投資風險的基礎上，為基金份額持有人謀求最大利益，沒有損害基金份額持有人利益的行為。

#### 4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明

##### 4.3.1 公平交易制度的執行情況

本基金管理人一貫公平對待旗下管理的所有基金及組合，制定並嚴格遵守相應的制度及流程，通過系統及人工等方式在各環節嚴格控制交易公平執行。報告期內，本公司嚴格執行了《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》及《華夏基金管理有限公司公平交易制度》的規定。

##### 4.3.2 異常交易行為的專項說明

報告期內未發現本基金存在異常交易行為。

報告期內，未出現涉及本基金的交易所公開競價同日反向交易成交較少的單邊交易量超過該證券當日成交量 5% 的情況。

#### 4.4 管理人對報告期內基金的投資策略及業績表現的說明

##### 4.4.1 報告期內基金投資策略及運作分析

2016 年初，受美元加息、人民幣匯率大幅波動以及熔断制度實施的多重影響，A 股市場快速下跌。在大批擇時交易者恐慌離場後，市場開始風格轉換並

形成部分修復。進入 2 季度，A 股市場呈現出震盪偏弱的走勢，市場雖仍受到流動性因素的主導，但投資者逐步把注意力重新轉向經濟基本面。政策層面從鼓勵創新轉向更多強調風險可控，排除了利用貨幣政策繼續大水漫灌的可能性，但實體經濟的需求復蘇仍面臨巨大挑戰。2 季度後期，市場在反復考驗了 2800 點附近的短期支撐後，部分成長股表現突出，反彈幅度較大，但市場熱點一直無法有效擴散，成交量穩定在相對較低水準。

報告期內，本基金保持了基本穩定的股票投資比例，淡化了股票倉位選擇的考量，因為我們認為在擇時交易中投資者過於擁擠，難以創造超額收益。同時調整了板塊配置比例，繼續增持了穩定增長類股票，並適度提高了個股集中度。

#### 4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份額淨值為 1.664 元，本報告期份額淨值增長率為-12.47%，同期業績比較基準增長率為-10.16%。

#### 4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

展望下一階段，我們認為，今年以來一系列國際政治經濟事件反映出我們可能處於一個長期環境的轉折階段。2008 年金融危機以來的用寬鬆貨幣環境換取實體經濟增長恢復的政策努力收效甚微，在經濟復蘇遙遙無期的情況下，各國政經環境趨向保守，全球化的進程放緩甚至部分逆轉。從較長時間來看，我們可能不得不為金融市場的風險加大做好準備。從短期來看，中國相對獨立的金融市場對風險起到了部分緩衝作用，但由於中國是過去若干年世界經濟全球化的最大受益者之一，我們在新環境下面臨的轉型挑戰亦最為艱巨。我們只有繼續推進有效改革，把握發展的歷史機遇期，才能給經濟的持續健康發展創造

條件。

下半年，預計 A 股市場將呈現結構分化，我們將繼續增加穩健增長類品種在組合中的比例，用個股的相對確定應對市場的相對不確定。

綜合而言，我們繼續強調“自下而上”的個股選擇在未來階段投資中的重要性，並準備適時調整組合的行業及風格配置，爭取以專業投資為持有人提供合理的回報。

珍惜基金份額持有人的每一分投資及每一份信任，本基金將繼續奉行華夏基金管理有限公司“為信任奉獻回報”的經營理念，規範運作，審慎投資，勤勉盡責地為基金份額持有人謀求長期、穩定的回報。

#### 4.6 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明

根據中國證監會相關規定及基金合同約定，本基金管理人應嚴格按照新準則、中國證監會相關規定及基金合同關於估值的約定，對基金所持有的投資品種進行估值。本基金託管人根據法律法規要求履行估值及淨值計算的覆核責任。會計師事務所在估值調整導致基金資產淨值的變化在 0.25% 以上時對所採用的相關估值模型、假設及參數的適當性發表審核意見並發出報告。定價服務機構按照商業合同約定提供定價服務。其中，本基金管理人為了確保估值工作的合規開展，建立了負責估值工作決策及執行的專門機構，組成人員包括主管基金運營的公司領導或其授權人、督察長、投資風控工作負責人、證券研究工作負責人、合規負責人及基金會計工作負責人等，以上人員具有豐富的風控、證券研究、合規、會計方面的專業經驗。同時，根據基金管理公司制定的相關制度，估值工作決策機構的成員中不包括基金經理。本報告期內，參與估值流程各方之間無重大利益衝突。

#### 4.7 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明

本基金本報告期未進行利潤分配，符合相關法規及基金合同的規定。

#### 4.8 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的說明

報告期內，本基金未出現連續二十個工作日基金份額持有人數量不滿二百人或者基金資產淨值低於五千萬元的情形。

### §5 託管人報告

#### 5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明

本報告期，中國建設銀行股份有限公司在本基金的託管過程中，嚴格遵守了《證券投資基金法》、基金合同、託管協議及其他有關規定，不存在損害基金份額持有人利益的行為，完全盡職盡責地履行了基金託管人應盡的義務。

#### 5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的說明

本報告期，本託管人按照國家有關規定、基金合同、託管協議及其他有關規定，對本基金的基金資產淨值計算、基金費用開支等方面進行了認真的覆核，對本基金的投資運作方面進行了監督，未發現基金管理人有損害基金份額持有人利益的行為。

報告期內，本基金未實施利潤分配。

#### 5.3 託管人對本半年度報告中財務資訊等內容的真實、準確及完整發表意見

本託管人覆核審查了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證覆核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

## §6 半年度財務會計報告（未經審計）

### 6.1 資產負債表

會計主體：華夏興華混合型證券投資基金

報告截止日：2016 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>資產：</b>			
銀行存款	6.4.7.1	193,768,039.26	157,595,942.59
結算備付金		1,428,166.76	6,192,688.53
存出保證金		390,441.13	901,367.83
交易性金融資產	6.4.7.2	1,046,334,047.06	1,363,042,911.86
其中：股票投資		1,035,835,047.06	1,352,468,911.86
基金投資		-	-
債券投資		10,499,000.00	10,574,000.00
資產支持證券投資		-	-
貴金屬投資		-	-
衍生金融資產	6.4.7.3	-	-
買入返售金融資產	6.4.7.4	-	-
應收證券清算款		2,127,100.77	-
應收利息	6.4.7.5	310,472.25	56,619.06
應收股利		-	-
應收申購款		132,938.18	576,927.82
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	6.4.7.6	218,378.00	218,378.00
資產總計		1,244,709,583.41	1,528,584,835.69
<b>負債及所有者權益</b>	<b>附注號</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>負債：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	6.4.7.3	-	-

賣出回購金融資產款		-	-
應付證券清算款		2,474.60	-
應付贖回款		1,424,581.94	7,487,906.45
應付管理人報酬		1,492,605.95	1,920,551.31
應付託管費		248,767.67	320,091.89
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用	6.4.7.7	18,146,996.24	21,485,546.12
應交稅費		783,413.95	783,413.95
應付利息		-	-
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.7.8	588,646.63	694,930.64
負債合計		22,687,486.98	32,692,440.36
<b>所有者權益：</b>			
實收基金	6.4.7.9	697,685,362.69	747,589,382.28
未分配利潤	6.4.7.10	524,336,733.74	748,303,013.05
所有者權益合計		1,222,022,096.43	1,495,892,395.33
負債及所有者權益總計		1,244,709,583.41	1,528,584,835.69

注：報告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份額淨值 1.664 元，基金份額總額 734,268,811.63 份。

## 6.2 利潤表

會計主體：華夏興華混合型證券投資基金

本報告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-175,652,659.16	790,683,302.14
1.利息收入		826,400.88	1,519,702.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	573,788.86	701,792.44
債券利息收入		252,612.02	817,909.58
資產支持證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		-174,902,923.69	850,105,173.15
其中：股票投資收益	6.4.7.12	-178,314,043.56	841,434,985.63
基金投資收益		-	-
債券投資收益	6.4.7.13	-	-79,480.00
資產支持證券投資收益	6.4.7.14	-	-
貴金屬投資收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	3,411,119.87	8,749,667.52
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	6.4.7.18	-1,630,730.82	-61,405,964.92
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	6.4.7.19	54,594.47	464,391.89
<b>減：二、費用</b>		15,984,505.77	27,170,807.65
1.管理人報酬		9,370,489.30	13,191,603.78
2.託管費		1,561,748.28	2,198,600.65
3.銷售服務費		-	-
4.交易費用	6.4.7.20	4,941,415.32	11,659,845.92
5.利息支出		-	-
其中：賣出回購金融資產支出		-	-
6.其他費用	6.4.7.21	110,852.87	120,757.30
<b>三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）</b>		-191,637,164.93	763,512,494.49
減：所得稅費用		-	-
<b>四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）</b>		-191,637,164.93	763,512,494.49

### 6.3 所有者權益（基金淨值）變動表

會計主體：華夏興華混合型證券投資基金

本報告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益（基金淨值）	747,589,382.28	748,303,013.05	1,495,892,395.33
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數（本期利	-	-191,637,164.93	-191,637,164.93



潤)			
三、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數(淨值減少以“-”號填列)	-49,904,019.59	-32,329,114.38	-82,233,133.97
其中：1.基金申購款	49,101,574.74	34,135,845.10	83,237,419.84
2.基金贖回款	-99,005,594.33	-66,464,959.48	-165,470,553.81
四、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動(淨值減少以“-”號填列)	-	-	-
五、期末所有者權益(基金淨值)	697,685,362.69	524,336,733.74	1,222,022,096.43
項目	上年度可比期間		
	2015年1月1日至2015年6月30日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益(基金淨值)	1,025,956,197.33	329,159,968.58	1,355,116,165.91
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數(本期利潤)	-	763,512,494.49	763,512,494.49
三、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數(淨值減少以“-”號填列)	-220,706,219.98	-224,989,072.27	-445,695,292.25
其中：1.基金申購款	200,804,505.93	194,619,591.38	395,424,097.31
2.基金贖回款	-421,510,725.91	-419,608,663.65	-841,119,389.56
四、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動(淨值減少以“-”號填列)	-	-	-
五、期末所有者權益(基金淨值)	805,249,977.35	867,683,390.80	1,672,933,368.15

報表附注為財務報表的組成部分。

本報告 6.1 至 6.4 財務報表由下列負責人簽署：

楊明輝	汪貴華	汪貴華
基金管理人負責人	主管會計工作負責人	會計機構負責人

## 6.4 報表附注

### 6.4.1 基金基本情況

根據原興華證券投資基金（以下簡稱“基金興華”）基金份額持有人大會審議通過的《關於興華證券投資基金轉型有關事項的議案》，並經中國證券監督管理委員會（以下簡稱“中國證監會”）證監許可[2013]277 號《關於核准興華證券投資基金基金份額持有人大會有關轉換基金運作方式決議的批復》及上海證券交易所上證基字[2013]95 號《關於終止興華證券投資基金上市的決定》的同意，基金興華於 2013 年 4 月 11 日進行終止上市權利登記，2013 年 4 月 12 日終止上市。原《興華證券投資基金基金合同》於終止上市日起失效，《華夏興華混合型證券投資基金基金合同》於同日起生效，同時基金興華更名為華夏興華混合型證券投資基金（以下簡稱“本基金”）。本基金為契約型開放式，存續期限為不定期。本基金的基金管理人為華夏基金管理有限公司，基金託管人為中國建設銀行股份有限公司。根據基金管理人 2015 年 7 月 2 日刊登的《華夏基金管理有限公司關於修訂華夏興華混合型證券投資基金基金合同的公告》，本基金自 2015 年 7 月 2 日起增加 H 類基金份額類別。

根據《華夏興華混合型證券投資基金招募說明書》，基金管理人華夏基金管理有限公司確定 2013 年 5 月 15 日為基金興華基金份額折算基準日。經本基金管理人計算並經基金託管人覆核的折算前基金份額淨值為 1.052 元，精確到小數點後第 9 位為 1.052420524 元（第 10 位捨去），本基金管理人按照 1.052420524 的折算比例對原興華證券投資基金進行了基金份額折算，折算後的基金份額淨值為 1.000 元，折算後的基金份額為折算前的基金份額乘以折算比例，採用截尾法保留到整數位元，所產生的誤差歸入基金財產。折算前原興華證券投資基金份額總額為 20 億份，折算後基金份額總額為 2,104,814,287 份。

本基金於基金合同生效後自 2013 年 4 月 18 日至 2013 年 5 月 10 日期間內

開放集中申購，共募集 1,355,413,663.50 元，其中用於折合基金份額的集中申購資金利息共計 353,522.99 元，業經德勤華永會計師事務所（特殊普通合夥）德師報（驗）字（13）第 0084 號審驗報告予以驗證。上述集中申購募集資金折合為 1,355,413,663.50 份基金份額，其中集中申購資金利息折合 353,522.99 份基金份額。

根據《中華人民共和國證券投資基金法》及《華夏興華混合型證券投資基金基金合同》等有關規定，本基金的投資範圍為具有良好流動性的金融工具，包括國內依法發行的股票（包括創業板、中小板股票）、債券（含中小企業私募債券）、貨幣市場工具、權證、資產支援證券、股指期貨以及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具。

#### 6.4.2 會計報表的編制基礎

本基金的財務報表按照財政部於 2006 年 2 月 15 日及其後頒佈及修訂的《企業會計準則—基本準則》、各項具體會計準則及其他相關規定(以下合稱“企業會計準則”)、中國證券投資基金業協會(以下簡稱“中國基金業協會”)於 2012 年 11 月 16 日頒佈的《證券投資基金會計核算業務指引》、中國證監會發佈的《證券投資基金信息披露 XBRL 範本第 3 號<年度報告和半年度報告>》及中國證監會、中國基金業協會允許的如財務報表附注 6.4.4 所列示的基金行業實務操作的有關規定編制。

#### 6.4.3 遵循企業會計準則及其他有關規定的聲明

本財務報表符合企業會計準則的要求，真實、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的財務狀況以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期間的經營成果及基金淨值變動情況等有關資訊。

#### 6.4.4 本報告期所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度報告相一致的說明

本基金本報告期會計報表所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度會計報表所採用的會計政策、會計估計一致。

#### 6.4.5 會計政策及會計估計變更以及差錯更正的說明

##### 6.4.5.1 會計政策變更的說明

本基金本報告期無會計政策變更。

##### 6.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期無會計估計變更。

##### 6.4.5.3 差錯更正的說明

本基金本報告期無重大會計差錯的內容及更正金額。

#### 6.4.6 稅項

根據財政部、國家稅務總局財稅[2002]128 號《關於開放式證券投資基金有關稅收問題的通知》、財稅[2004]78 號《關於證券投資基金稅收政策的通知》、財稅[2005]103 號《關於股權分置試點改革有關稅收政策問題的通知》、財稅[2008]1 號《關於企業所得稅若干優惠政策的通知》、財稅[2012]85 號《關於實施上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2015]101 號《關於上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2016]36 號《關於全面推開營業稅改增值稅試點的通知》、財稅[2016]46 號《財政部、國家稅務總局關於進一步明確全面推開營改增試點金融業有關政策的通知》及其他相關財稅法規及實務操作，主要稅項列示如下：

1、以發行基金方式募集資金不屬於營業稅或增值稅徵收範圍，不徵收營業稅或增值稅。

2、基金買賣股票、債券的差價收入暫免徵營業稅及企業所得稅。

3、存款利息收入不徵收增值稅。

4、國債、地方政府債及政策性金融債券利息收入、質押式買入返售金融商品利息收入、基金買賣股票、債券的差價收入免徵增值稅。

5、對基金取得的股票的股息、紅利收入、債券的利息收入，由上市公司、債券發行企業在向基金派發股息、紅利收入、利息收入時代扣代繳 20% 的個人所得稅，暫不徵收企業所得稅。基金從上市公司分配取得的股息紅利所得，持股期限在 1 個月以內（含 1 個月）的，全額計入應納稅所得額，持股期限在 1 個月以上至 1 年（含 1 年）的，減按 50% 計入應納稅所得額，持股期限超過 1 年的，自 2015 年 9 月 8 日起暫免徵收個人所得稅。

6、基金賣出股票按 0.1% 的稅率繳納股票交易印花稅，買入股票不徵收股票交易印花稅。

7、基金作為流通股股東在股權分置改革過程中收到由非流通股股東支付的股份、現金等對價暫免徵收印花稅、企業所得稅及個人所得稅。

#### 6.4.7 重要財務報表項目的說明

##### 6.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	193,768,039.26
定期存款	-
其他存款	-
合計	193,768,039.26

##### 6.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允價值	公允價值變動
股票	1,001,076,432.22	1,035,835,047.06	34,758,614.84
貴金屬投資-金交所黃金合約	-	-	-
債券	交易所市場	-	-
	銀行間市場	10,000,347.95	10,499,000.00
	合計	10,000,347.95	10,499,000.00
資產支持證券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合計	1,011,076,780.17	1,046,334,047.06	35,257,266.89

#### 6.4.7.3 衍生金融資產/負債

本基金本報告期末無衍生金融資產/負債餘額。

#### 6.4.7.4 買入返售金融資產

##### 6.4.7.4.1 各項買入返售金融資產期末餘額

本基金本報告期末未持有買入返售金融資產。

##### 6.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

本基金本報告期末未持有買斷式逆回購交易中取得的債券。

#### 6.4.7.5 應收利息

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年6月30日
應收活期存款利息	36,222.16
應收定期存款利息	-
應收其他存款利息	-
應收結算備付金利息	642.70
應收債券利息	273,431.69
應收買入返售證券利息	-
應收申購款利息	-

應收黃金合約拆借孳息	-
其他	175.70
合計	310,472.25

#### 6.4.7.6 其他資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年6月30日
其他應收款	218,378.00
待攤費用	-
合計	218,378.00

#### 6.4.7.7 應付交易費用

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年6月30日
交易所市場應付交易費用	18,146,996.24
銀行間市場應付交易費用	-
合計	18,146,996.24

#### 6.4.7.8 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年6月30日
應付券商交易單元保證金	500,000.00
應付贖回費	4,111.27
預提費用	84,535.36
合計	588,646.63

#### 6.4.7.9 實收基金

金額單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份額(份)	帳面金額
上年度末	786,779,424.54	747,589,382.28
本期申購	51,672,619.16	49,101,574.74

本期贖回（以“-”號填列）	-104,183,232.07	-99,005,594.33
本期末	734,268,811.63	697,685,362.69

#### 6.4.7.10 未分配利潤

單位：人民幣元

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	850,083,987.55	-101,780,974.50	748,303,013.05
本期利潤	-190,006,434.11	-1,630,730.82	-191,637,164.93
本期基金份額交易產生的變動數	-43,940,564.36	11,611,449.98	-32,329,114.38
其中：基金申購款	49,061,565.42	-14,925,720.32	34,135,845.10
基金贖回款	-93,002,129.78	26,537,170.30	-66,464,959.48
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	616,136,989.08	-91,800,255.34	524,336,733.74

#### 6.4.7.11 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	547,344.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
結算備付金利息收入	22,006.68
其他	4,437.39
合計	573,788.86

#### 6.4.7.12 股票投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
賣出股票成交總額	1,678,000,754.87
減：賣出股票成本總額	1,856,314,798.43
買賣股票差價收入	-178,314,043.56

#### 6.4.7.13 債券投資收益

本基金本報告期無債券投資收益。



6.4.7.14 資產支持證券投資收益

本基金本報告期無資產支持證券投資收益。

6.4.7.15 貴金屬投資收益

6.4.7.15.1 貴金屬投資收益項目構成

本基金本報告期無貴金屬投資收益。

6.4.7.15.2 貴金屬投資——買賣貴金屬差價收入

本基金本報告期無貴金屬投資收益。

6.4.7.15.3 貴金屬投資——贖回差價收入

本基金本報告期無貴金屬投資收益。

6.4.7.15.4 貴金屬投資——申購差價收入

本基金本報告期無貴金屬投資收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

本基金本報告期無買賣權證差價收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本報告期無其他衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投資產生的股利收益	3,411,119.87
基金投資產生的股利收益	-
合計	3,411,119.87

6.4.7.18 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融資產	-1,630,730.82
——股票投資	-1,555,730.82
——債券投資	-75,000.00
——資產支持證券投資	-
——基金投資	-
——貴金屬投資	-
2.衍生工具	-
——權證投資	-
3.其他	-
合計	-1,630,730.82

6.4.7.19 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金贖回費收入	54,594.47
合計	54,594.47

6.4.7.20 交易費用

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市場交易費用	4,941,415.32
銀行間市場交易費用	-
合計	4,941,415.32

6.4.7.21 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
審計費用	44,753.80
信息披露費	39,781.56
銀行間帳戶維護費	18,000.00

銀行費用	7,517.51
其他	800.00
合計	110,852.87

#### 6.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

##### 6.4.8.1 或有事項

截至資產負債表日，本基金無或有事項。

##### 6.4.8.2 資產負債表日後事項

截至財務報表批准日，本基金無資產負債表日後事項。

#### 6.4.9 關聯方關係

##### 6.4.9.1 本報告期存在控制關係或其他重大利害關係的關聯方發生變化的情況

本基金本報告期不存在控制關係或其他重大利害關係的關聯方發生變化的情況。

##### 6.4.9.2 本報告期與基金發生關聯交易的各關聯方

關聯方名稱	與本基金的關係
華夏基金管理有限公司	基金管理人、基金銷售機構
中國建設銀行股份有限公司(“中國建設銀行”)	基金託管人、基金銷售機構

注：下述關聯交易均在正常業務範圍內按一般商業條款訂立。

#### 6.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

##### 6.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本報告期及上年度可比期間均未通過關聯方交易單元進行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 權證交易

本基金本報告期及上年度可比期間均未通過關聯方交易單元進行權證交易。

###### 6.4.10.1.3 債券交易

本基金本報告期及上年度可比期間均未通過關聯方交易單元進行債券交易。

#### 6.4.10.1.4 債券回購交易

本基金本報告期及上年度可比期間均未通過關聯方交易單元進行回購交易。

#### 6.4.10.1.5 應支付關聯方的佣金

本基金本報告期及上年度可比期間均無應支付關聯方的佣金。

#### 6.4.10.2 關聯方報酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年6月30日
當期發生的基金應支付的管理費	9,370,489.30	13,191,603.78
其中：支付銷售機構的客戶維護費	631,743.64	743,940.49

注：①支付基金管理人的基金管理人報酬按前一日基金資產淨值 1.5% 的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金管理人報酬計算公式為：日基金管理人報酬 = 前一日基金資產淨值 × 1.5% / 當年天數。

③客戶維護費是指基金管理人與基金銷售機構約定的用以向基金銷售機構支付客戶服務及銷售活動中產生的相關費用，該費用按照代銷機構所代銷基金的份額保有量作為基數進行計算，從基金管理人收取的基金管理費中列支，不屬於從基金資產中列支的費用項目。

##### 6.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年6月30日
當期發生的基金應支付的託管費	1,561,748.28	2,198,600.65

注：①支付基金託管人的基金託管費按前一日基金資產淨值 0.25% 的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金託管費計算公式為：日基金託管費=前一日基金資產淨值×0.25%/當年天數。

#### 6.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

本基金本報告期及上年度可比期間均未與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易。

#### 6.4.10.4 各關聯方投資本基金的情況

##### 6.4.10.4.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

份額單位：份

項目	本期	上年度可比期間
	2016年1月1日至 2016年6月30日	2015年1月1日至 2015年6月30日
期初持有的基金份額	124,156,009.58	117,339,377.00
期間申購/買入總份額	-	-
期間因拆分變動份額	-	-
減：期間贖回/賣出總份額	-	-
期末持有的基金份額	124,156,009.58	117,339,377.00
期末持有的基金份額佔基金總份額比例	16.91%	13.85%

##### 6.4.10.4.2 報告期末除基金管理人之外的其他關聯方投資本基金的情況

本基金本報告期末及上年度末均無除基金管理人之外的其他關聯方投資本基金的情況。

#### 6.4.10.5 由關聯方保管的銀行存款餘額及當期產生的利息收入

單位：人民幣元

關聯方名稱	本期		上年度可比期間	
	2016年1月1日至 2016年6月30日		2015年1月1日至 2015年6月30日	
	期末餘額	當期利息收入	期末餘額	當期利息收入
中國建設銀行活期存款	193,768,039.26	547,344.79	220,035,380.27	620,454.89

注：本基金的活期銀行存款由基金託管人中國建設銀行保管，按銀行同業利率計息。

6.4.10.6 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

本基金本報告期及上年度可比期間均未通過關聯方購買其承銷的證券。

6.4.11 利潤分配情況

本基金本報告期無利潤分配事項。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限證券

6.4.12.1 因認購新發/增發證券而於期末持有的流通受限證券

金額單位：人民幣元

6.4.12.1.1 受限證券類別：股票										
證券代碼	證券名稱	成功認購日	可流通日	流通受限類型	認購價格	期末估值單價	數量（單位：股）	期末成本總額	期末估值總額	備註
601966	玲瓏輪胎	2016-06-24	2016-07-06	新發流通受限	12.98	12.98	9,862	128,008.76	128,008.76	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新發流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大國創	2016-06-30	2016-07-08	新發流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	豐元股份	2016-06-29	2016-07-07	新發流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

6.4.12.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

金額單位：人民幣元

股票代碼	股票名稱	停牌日期	停牌原因	期末估值單價	複牌日期	複牌開盤單價	數量（股）	期末成本總額	期末估值總額	備註
600497	馳宏鋅鋇	2016-06-13	重大事項	9.97	2016-07-11	10.97	3,936,600	43,331,605.63	39,247,902.00	-
000401	冀東水泥	2016-04-06	重大事項	10.60	2016-07-14	11.32	3,467,241	35,670,107.44	36,752,754.60	-
000004	國農科技	2016-03-24	重大事項	36.83	-	-	300,000	9,437,193.50	11,049,000.00	-
300284	蘇交科	2016-05-20	重大事項	19.49	2016-08-10	21.44	473,503	9,544,101.44	9,228,573.47	-
000932	華菱鋼鐵	2016-03-28	重大事項	3.95	2016-08-08	4.35	310,211	1,153,393.85	1,225,333.45	-

601611	中國核建	2016-06-30	重大事項	20.92	2016-07-01	23.01	34,790	120,721.30	727,806.80	-
--------	------	------------	------	-------	------------	-------	--------	------------	------------	---

注：上述股票的複牌日期及複牌開盤單價更新截至本財務報表批准日。

#### 6.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

##### 6.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

截至本報告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金沒有因從事銀行間市場債券正回購交易形成的賣出回購證券款餘額。

##### 6.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

截至本報告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金沒有因從事交易所市場債券正回購交易形成的賣出回購證券款餘額。

#### 6.4.13 金融工具風險及管理

##### 6.4.13.1 風險管理政策及組織架構

本基金一貫的風險管理政策是使基金投資風險可測、可控、可承擔。本基金管理人建立了由風險管理委員會、督察長、法律部、合規部、稽核部、風險管理部及相關業務部門構成的多層次風險管理架構體系。風險管理團隊在識別、衡量投資風險後，通過正式報告的方式，將分析結果及時傳達給基金經理、投資總監、投資決策委員會及風險管理委員會，協助制定風險控制決策，實現風險管理目標。

本基金管理人主要通過定性分析及定量分析的方法，估測各種金融工具風險可能產生的損失。本基金管理人從定性分析的角度出發，判斷風險損失的嚴重性；從定量分析的角度出發，根據本基金的投資目標，結合基金資產所運用的金融工具特徵，通過特定的風險量化指標、模型及日常的量化報告，確定風險損失的限度及相應置信程度，及時對各種風險進行監督、檢查及評估，並制

定相應決策，將風險控制在預期可承受的範圍內。

#### 6.4.13.2 信用風險

信用風險是指由於基金所投資債券的發行人出現違約、拒絕支付到期本息，債券發行人信用評級降低導致債券價格下降，或基金在交易過程中發生交收違約，而造成基金資產損失的可能性。

本基金管理人通過信用分析團隊建立了內部評級體系及交易對手庫，對發行人及債券投資進行內部評級，對交易對手的資信狀況進行充分評估、設定授信額度，以控制可能出現的信用風險。

#### 6.4.13.3 流動性風險

流動性風險是在市場或持有資產流動性不足的情況下，基金管理人可能無法迅速、低成本地調整基金投資組合，從而對基金收益造成不利影響。

本基金管理人通過限制投資集中度來管理投資品種變現的流動性風險。本基金所投資的證券在證券交易所或銀行間市場交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限證券”中列示的部分基金資產流通暫時受限制的情況外，其餘均能及時變現。

#### 6.4.13.4 市場風險

市場風險是指由於市場變化或波動所引起的資產損失的可能性，本基金管理人通過監測組合久期、Beta 值等指標來衡量市場風險。

##### 6.4.13.4.1 利率風險

利率風險是指利率變動引起組合中資產特別是債券投資的市場價格變動，從而影響基金投資收益的風險。

本基金管理人定期對組合中債券投資部分面臨的利率風險進行監控，並通



過調整投資組合的久期等方法對上述利率風險進行管理。

6.4.13.4.1.1 承受利率風險

單位：人民幣元

本期末 2016年6月30日	1年以內	1-5年	5年以上	合計
銀行存款	193,768,039.26	-	-	193,768,039.26
結算備付金	1,428,166.76	-	-	1,428,166.76
結算保證金	390,441.13	-	-	390,441.13
債券投資	-	10,499,000.00	-	10,499,000.00
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	-	-	-	-
應收直銷申購款	33,241.65	-	-	33,241.65
賣出回購金融資產款	-	-	-	-
上年度末 2015年12月31日	1年以內	1-5年	5年以上	合計
銀行存款	157,595,942.59	-	-	157,595,942.59
結算備付金	6,192,688.53	-	-	6,192,688.53
結算保證金	901,367.83	-	-	901,367.83
債券投資	-	10,574,000.00	-	10,574,000.00
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	-	-	-	-
應收直銷申購款	457,506.78	-	-	457,506.78
賣出回購金融資產款	-	-	-	-

注：本表所示為本基金生息資產及負債的公允價值，並按照合約規定的利率重新定價日或到期日孰早者予以分類。

6.4.13.4.1.2 利率風險的敏感性分析

假設	1、該利率敏感性分析資料結果為基於本基金報表日組合持有固定收益類資產的利率風險狀況測算的理論變動值對基金資產淨值的影響金額。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度變動 25 個基點，其他市場變數均不發生變化。		
	3、此項影響並未考慮基金經理為降低利率風險而可能採取的風險管理活動。		
分析	相關風險變數的變動	對資產負債表日基金資產淨值的影響金額（單位：人民幣元）	
		本期末 (2016年6月30日)	上年度末 (2015年12月31日)

	利率下降 25 個基點	35,852.27	48,713.10
	利率上升 25 個基點	-35,640.67	-48,710.45

#### 6.4.13.4.2 外匯風險

本基金持有的金融工具以人民幣計價，因此無重大外匯風險。

#### 6.4.13.4.3 其他價格風險

其他價格風險為除市場利率及外匯匯率以外的市場因素發生變動時產生的價格波動風險。本基金的其他價格風險主要為市場價格變化或波動所引起的股票資產損失的可能性。

本基金通過投資組合的分散化降低市場價格風險。此外，本基金管理人對本基金所持有的股票價格實施監控，定期運用多種定量方法進行風險度量及分析，以對風險進行跟蹤及控制。

#### 6.4.13.4.3.1 承受其他價格風險

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
交易性金融資產-股票投資	1,035,835,047.06	84.76	1,352,468,911.86	90.41
交易性金融資產-貴金屬投資	-	-	-	-
衍生金融資產-權證投資	-	-	-	-
合計	1,035,835,047.06	84.76	1,352,468,911.86	90.41

#### 6.4.13.4.3.2 其他價格風險的敏感性分析

假設	1、估測組合市場價格風險的資料為滬深 300 指數變動時，股票資產相應的理論變動值對基金資產淨值的影響金額。	
	2、假定滬深 300 指數變化 5%，其他市場變數均不發生變化。	
	3、Beta 係數是根據組合在報表日股票持倉資產在過去 100 個交易日與其對應的指數資料回歸加權得出，對於交易少於 100 個交易日的資產，預設其波動與市場同步。	
分析	相關風險變數的變動	對資產負債表日基金資產淨值的影響金額（單位：人民幣元）

		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	+5%	71,084,180.10	82,061,051.23
	-5%	-71,084,180.10	-82,061,051.23

#### 6.4.14 有助於理解及分析會計報表需要說明的其他事項

##### 6.4.14.1 金融工具公允價值計量的方法

根據企業會計準則的相關規定，以公允價值計量的金融工具，其公允價值的計量可分為三個層次：

第一層次：對存在活躍市場報價的金融工具，可以相同資產/負債在活躍市場上的報價確定公允價值。

第二層次：對估值日活躍市場無報價的金融工具，可以類似資產/負債在活躍市場上的報價為依據做必要調整確定公允價值；對估值日不存在活躍市場的金融工具，可以相同或類似資產/負債在非活躍市場上的報價為依據做必要調整確定公允價值。

第三層次：對無法獲得相同或類似資產可比市場交易價格的金融工具，可以其他反映市場參與者對資產/負債定價時所使用的參數為依據確定公允價值。

##### 6.4.14.2 各層次金融工具公允價值

截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允價值計量的金融工具第一層次的餘額為 999,082,292.46 元，第二層次的餘額為 47,251,754.60 元，第三層次的餘額為 0 元。（截至 2015 年 12 月 31 日止：第一層次的餘額為 1,318,058,352.18 元，第二層次的餘額為 44,984,559.68 元，第三層次的餘額為 0 元。）

##### 6.4.14.3 公允價值所屬層次間的重大變動

對於特殊事項停牌的股票、收盤價異常的債券，本基金將相關股票及債券

公允價值所屬層次於其進行估值調整之日起從第一層次轉入第二層次或第三層次，於股票復牌、債券收盤價能體現公允價值並恢復市價估值之日起從第二層次或第三層次轉入第一層次。對於持有的非公開發行股票，本基金於限售期內將相關股票公允價值所屬層次列入第二層次，於限售期滿並恢復市價估值之日起從第二層次轉入第一層次。對於在證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種(可轉換債券、資產支持證券及私募債券除外)，本基金於 2015 年 3 月 20 日起改為採用中證指數有限公司根據《中國證券投資基金業協會估值核算工作小組關於 2015 年 1 季度固定收益品種的估值處理標準》所獨立提供的估值結果確定公允價值，並將其公允價值從第一層次調整至第二層次。

#### 6.4.14.4 第三層次公允價值本期變動金額

本基金持有的以公允價值計量的金融工具第三層次公允價值本期未發生變動。

## §7 投資組合報告

### 7.1 期末基金資產組合情況

金額單位：人民幣元

序號	項目	金額	佔基金總資產的比例 (%)
1	權益投資	1,035,835,047.06	83.22
	其中：股票	1,035,835,047.06	83.22
2	固定收益投資	10,499,000.00	0.84
	其中：債券	10,499,000.00	0.84
	資產支持證券	-	-
3	貴金屬投資	-	-
4	金融衍生品投資	-	-
5	買入返售金融資產	-	-
	其中：買斷式回購的買入返售金融資產	-	-
6	銀行存款及結算備付金合計	195,196,206.02	15.68

7	其他各項資產	3,179,330.33	0.26
8	合計	1,244,709,583.41	100.00

### 7.2 期末按行業分類的股票投資組合

金額單位：人民幣元

代碼	行業類別	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
A	農、林、牧、漁業	32,430,000.00	2.65
B	採礦業	39,247,902.00	3.21
C	製造業	836,469,002.05	68.45
D	電力、熱力、燃氣及水生產及供應業	-	-
E	建築業	31,218,739.58	2.55
F	批發及零售業	17,479,858.71	1.43
G	交通運輸、倉儲及郵政業	49,333,453.00	4.04
H	住宿及餐飲業	-	-
I	資訊傳輸、軟體及資訊技術服務業	70,492.40	0.01
J	金融業	-	-
K	房地產業	6,316,070.00	0.52
L	租賃及商務服務業	2,869,148.00	0.23
M	科學研究及技術服務業	9,365,381.32	0.77
N	水利、環境及公共設施管理業	-	-
O	居民服務、修理及其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生及社會工作	-	-
R	文化、體育及娛樂業	-	-
S	綜合	11,035,000.00	0.90
	合計	1,035,835,047.06	84.76

### 7.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資詳情

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	數量 (股)	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
1	300156	神霧環保	3,699,855	76,143,015.90	6.23
2	002007	華蘭生物	2,006,736	63,011,510.40	5.16
3	000807	雲鋁股份	9,454,378	61,926,175.90	5.07
4	300097	智雲股份	1,119,234	56,017,661.70	4.58
5	000403	ST 生化	1,759,981	52,077,837.79	4.26

6	601012	隆基股份	3,100,000	40,455,000.00	3.31
7	600497	馳宏鋅鋅	3,936,600	39,247,902.00	3.21
8	002690	美亞光電	1,679,181	38,688,330.24	3.17
9	600521	華海藥業	1,552,675	37,761,056.00	3.09
10	002366	台海核電	700,000	37,317,000.00	3.05
11	000401	冀東水泥	3,467,241	36,752,754.60	3.01
12	600115	東方航空	5,327,300	35,213,453.00	2.88
13	600887	伊利股份	2,000,000	33,340,000.00	2.73
14	300197	鐵漢生態	2,199,923	30,490,932.78	2.50
15	600518	康美藥業	2,000,000	30,380,000.00	2.49
16	002094	青島金王	949,893	25,371,642.03	2.08
17	300263	隆華節能	2,170,886	24,270,505.48	1.99
18	000820	金城股份	1,242,600	22,366,800.00	1.83
19	000831	*ST 五稀	1,591,700	20,978,606.00	1.72
20	002418	康盛股份	1,894,000	20,000,640.00	1.64
21	300393	中來股份	500,000	18,340,000.00	1.50
22	600975	新五豐	2,000,000	18,300,000.00	1.50
23	600337	美克家居	1,343,571	17,479,858.71	1.43
24	600171	上海貝嶺	1,000,000	17,370,000.00	1.42
25	002378	章源鎢業	1,646,700	17,208,015.00	1.41
26	000541	佛山照明	1,499,917	15,434,145.93	1.26
27	600197	伊力特	1,000,000	15,040,000.00	1.23
28	002321	華英農業	1,500,000	14,130,000.00	1.16
29	600029	南方航空	2,000,000	14,120,000.00	1.16
30	603308	應流股份	500,000	12,570,000.00	1.03
31	000902	新洋豐	976,200	12,212,262.00	1.00
32	000004	國農科技	300,000	11,049,000.00	0.90
33	000881	大連國際	500,000	11,035,000.00	0.90
34	000910	大亞科技	682,766	10,548,734.70	0.86
35	300284	蘇交科	473,503	9,228,573.47	0.76
36	300210	森遠股份	493,801	8,829,161.88	0.72
37	600963	岳陽林紙	1,322,200	8,091,864.00	0.66
38	000615	京漢股份	344,200	6,316,070.00	0.52
39	002588	史丹利	446,300	5,511,805.00	0.45
40	002511	中順潔柔	239,952	4,086,382.56	0.33
41	600057	象嶼股份	279,100	2,869,148.00	0.23
42	000932	華菱鋼鐵	310,211	1,225,333.45	0.10

43	601611	中國核建	34,790	727,806.80	0.06
44	600566	濟川藥業	26,300	676,962.00	0.06
45	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.02
46	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
47	300512	中亞股份	1,873	187,150.16	0.02
48	603339	四方冷鏈	2,793	151,995.06	0.01
49	601966	玲瓏輪胎	9,862	128,008.76	0.01
50	603779	威龍股份	2,808	117,823.68	0.01
51	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.01
52	603798	康普頓	1,590	101,585.10	0.01
53	603131	上海滬工	1,263	76,664.10	0.01
54	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.01
55	300518	盛訊達	1,306	61,186.10	0.01
56	002799	環球印務	1,080	47,131.20	0.00
57	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
58	002802	洪匯新材	1,629	24,565.32	0.00
59	603909	合誠股份	1,095	20,126.10	0.00
60	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
61	300520	科太國創	926	9,306.30	0.00
62	002805	豐元股份	971	5,631.80	0.00

#### 7.4 報告期內股票投資組合的重大變動

##### 7.4.1 累計買入金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票詳情

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計買入金額	佔期初基金資產淨值比例 (%)
1	002007	華蘭生物	54,577,693.80	3.65
2	300097	智雲股份	52,292,775.77	3.50
3	002690	美亞光電	51,455,944.04	3.44
4	000807	雲鋁股份	49,382,388.26	3.30
5	000709	河鋼股份	49,360,940.10	3.30
6	600497	馳宏鋅鋅	43,553,954.47	2.91
7	601012	隆基股份	39,143,292.57	2.62
8	600115	東方航空	38,041,993.00	2.54
9	000778	新興鑄管	37,853,503.24	2.53
10	002366	台海核電	36,295,708.68	2.43

11	000401	冀東水泥	35,670,107.44	2.38
12	000655	金嶺礦業	33,662,965.35	2.25
13	002094	青島金王	33,224,706.85	2.22
14	600887	伊利股份	32,398,380.78	2.17
15	000937	冀中能源	31,664,183.92	2.12
16	300197	鐵漢生態	31,282,312.92	2.09
17	600518	康美藥業	30,762,363.16	2.06
18	600428	中遠航運	26,821,647.71	1.79
19	002618	丹邦科技	23,646,963.89	1.58
20	000831	*ST 五稀	23,555,061.00	1.57

注：“買入金額”按買入成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

#### 7.4.2 累計賣出金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票詳情

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計賣出金額	佔期初基金資產淨值比例（%）
1	300077	國民技術	61,121,302.18	4.09
2	600559	老白乾酒	59,743,016.23	3.99
3	002630	華西能源	54,453,772.46	3.64
4	002299	聖農發展	53,412,462.62	3.57
5	002601	佰利聯	49,760,418.24	3.33
6	000807	雲鋁股份	44,886,447.91	3.00
7	300202	聚龍股份	44,643,245.29	2.98
8	000709	河鋼股份	42,709,633.15	2.86
9	600096	雲天化	42,285,138.33	2.83
10	000778	新興鑄管	33,780,319.54	2.26
11	002271	東方雨虹	32,474,072.46	2.17
12	600325	華髮股份	31,624,637.52	2.11
13	000596	古井貢酒	31,460,340.14	2.10
14	000655	金嶺礦業	29,968,747.46	2.00
15	002618	丹邦科技	29,635,683.71	1.98
16	000937	冀中能源	28,980,838.21	1.94
17	002444	巨星科技	28,085,061.27	1.88
18	002475	立訊精密	27,873,000.62	1.86
19	300180	華峰超纖	27,621,655.18	1.85
20	600584	長電科技	27,027,736.95	1.81



注：“賣出金額”按賣出成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

#### 7.4.3 買入股票的成本總額及賣出股票的收入總額

單位：人民幣元

買入股票成本（成交）總額	1,541,236,664.45
賣出股票收入（成交）總額	1,678,000,754.87

注：“買入股票成本”、“賣出股票收入”均按買賣成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

#### 7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合

金額單位：人民幣元

序號	債券品種	公允價值	佔基金資產淨值比例（%）
1	國家債券	-	-
2	央行票據	-	-
3	金融債券	-	-
	其中：政策性金融債	-	-
4	企業債券	-	-
5	企業短期融資券	-	-
6	中期票據	10,499,000.00	0.86
7	可轉債（可交換債）	-	-
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	10,499,000.00	0.86

#### 7.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有債券投資詳情

金額單位：人民幣元

序號	債券代碼	債券名稱	數量（張）	公允價值	佔基金資產淨值比例（%）
1	1282544	12 豫交投 MTN4	100,000	10,499,000.00	0.86
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資詳情

本基金本報告期末未持有資產支持證券。

7.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資詳情

本基金本報告期末未持有貴金屬。

7.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資詳情

本基金本報告期末未持有權證。

7.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明

7.10.1 報告期末本基金投資的股指期貨持倉及損益詳情

本基金本報告期末無股指期貨投資。

7.10.2 本基金投資股指期貨的投資政策

本基金本報告期末無股指期貨投資。

7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

7.11.1 本期國債期貨投資政策

本基金本報告期末無國債期貨投資。

7.11.2 報告期末本基金投資的國債期貨持倉及損益詳情

本基金本報告期末無國債期貨投資。

7.11.3 本期國債期貨投資評價

本基金本報告期末無國債期貨投資。

7.12 投資組合報告附注

7.12.1 報告期內，本基金投資決策程序符合相關法律法規的要求，未發現本基金

投資的前十名證券的發行主體本期出現被監管部門立案調查，或在報告編制日前一年內受到公開譴責、處罰的情形。

7.12.2 基金投資的前十名股票未超出基金合同規定的備選股票庫。

7.12.3 期末其他各項資產構成

單位：人民幣元

序號	名稱	金額
1	存出保證金	390,441.13
2	應收證券清算款	2,127,100.77
3	應收股利	-
4	應收利息	310,472.25
5	應收申購款	132,938.18
6	其他應收款	218,378.00
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	3,179,330.33

7.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券詳情

本基金本報告期末未持有處於轉股期的可轉換債券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	流通受限部分的公允價值	佔基金資產淨值比例（%）	流通受限情況說明
1	600497	馳宏鋅鋇	39,247,902.00	3.21	重大事項

7.12.6 投資組合報告附注的其他文字描述部分

由於四捨五入的原因，分項之及與合計項之間可能存在尾數差異。

## §8 基金份額持有人資訊

8.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構

份額單位：份

持有人戶數 (戶)	戶均持有的基金份額	持有人結構			
		機構投資者		個人投資者	
		持有份額	佔總份額比例	持有份額	佔總份額比例
40,226	18,253.59	166,218,107.85	22.64%	568,050,703.78	77.36%

### 8.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況

項目	持有份額總數 (份)	佔基金總份額比例
基金管理人所有從業人員持有本基金	586,159.09	0.08%

### 8.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況

項目	持有基金份額總量的數量區間 (萬份)
本公司高級管理人員、基金投資及研究部門負責人持有本開放式基金	10~50
本基金基金經理持有本開放式基金	10~50

## §9 開放式基金份額變動

單位：份

基金合同生效日 (2013年4月12日) 基金份額總額	2,000,000,000.00
本報告期期初基金份額總額	786,779,424.54
本報告期基金總申購份額	51,672,619.16
減：本報告期基金總贖回份額	104,183,232.07
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	734,268,811.63

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份額持有人大會決議

本報告期內，本基金未召開基金份額持有人大會。

### 10.2 基金管理人、基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動

根據本基金管理人發佈的相關公告，孫毅先生自 2016 年 1 月 1 日起任華夏基金管理有限公司副總經理，自 2016 年 6 月 30 日起不再擔任華夏基金管理有限公司副總經理。

本報告期內，本基金託管人的專門基金託管部門未發生重大人事變動。

### 10.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟

本報告期無涉及本基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟事項。

### 10.4 基金投資策略的改變

本基金本報告期投資策略未發生改變。

### 10.5 為基金進行審計的會計師事務所情況

本報告期內本基金所聘用的會計師事務所未發生改變。

### 10.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本基金管理人、基金託管人涉及託管業務的部門及其高級管理人員在本報告期內未受到任何處分。

### 10.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

#### 10.7.1 基金租用證券公司交易單元進行股票投資及佣金支付情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	交易單元數量	股票交易		應支付該券商的佣金		備註
		成交金額	佔當期股票成交總額的比例	佣金	佔當期佣金總量的比例	
國信證券	1	1,112,385,864.21	34.57%	1,035,963.67	34.79%	-
招商證券	1	857,764,231.75	26.66%	798,836.36	26.82%	-
中金公司	1	402,063,245.64	12.50%	374,443.15	12.57%	-
國都證券	1	361,728,132.46	11.24%	336,877.75	11.31%	-
中信建投證券	1	233,307,537.44	7.25%	217,280.39	7.30%	-
申萬宏源證券	1	94,806,334.84	2.95%	88,293.50	2.96%	-
廣發證券	3	92,014,882.94	2.86%	67,288.43	2.26%	-
國泰君安證券	1	63,369,243.65	1.97%	59,015.59	1.98%	-

注：①為了貫徹中國證監會的有關規定，我公司制定了選擇券商的標準，即：

i 經營行為規範，在近一年內無重大違規行為。

ii 公司財務狀況良好。

iii 有良好的內控制度，在業內有良好的聲譽。

iv 有較強的研究能力，能及時、全面、定期提供品質較高的宏觀、行業、公司及證券市場研究報告，並能根據基金投資的特殊要求，提供專門的研究報告。

v 建立了廣泛的資訊網路，能及時提供準確的信息資訊及服務。

② 券商專用交易單元選擇程序：

i 對交易單元候選券商的研究服務進行評估

本基金管理人組織相關人員依據交易單元選擇標準對交易單元候選券商的服務品質及研究實力進行評估，確定選用交易單元的券商。

ii 協議簽署及通知託管人

本基金管理人與被選擇的券商簽訂交易單元租用協議，並通知基金託管人。

③ 除本表列示外，本基金還選擇了國海證券、中國銀河證券、國元證券、浙商證券的交易單元作為本基金交易單元，本報告期無股票交易及應付佣金。

④ 在上述租用的券商交易單元中，浙商證券的部分交易單元為本基金本期新增的交易單元。本期沒有剔除的券商交易單元。

### 10.7.2 基金租用證券公司交易單元進行其他證券投資的情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	債券交易		回購交易	
	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期回購成交總額的比例
-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序號	公告事項	法定披露方式	法定披露日期
1	華夏基金管理有限公司關於指數熔斷當日旗下基金申購、贖回等業務安排的提示性公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-04
2	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-04
3	華夏基金管理有限公司關於指數熔斷期間旗下基金場內申贖業務安排的提示性公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-05

4	華夏基金管理有限公司關於指數熔斷當日旗下基金申購、贖回等業務安排的提示性公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-07
5	華夏基金管理有限公司關於公司董事、監事、高級管理人員及其他從業人員在子公司兼職等情況的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-13
6	華夏基金管理有限公司關於調整中國建設銀行儲蓄卡基金電子交易優惠費率的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-21
7	華夏基金管理有限公司關於設立上海華夏財富投資管理有限公司的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-30
8	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增聯訊證券股份有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-02-18
9	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增江蘇江南農村商業銀行股份有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-03-03
10	華夏基金管理有限公司關於公司董事、監事、高級管理人員及其他從業人員在子公司兼職等情況的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-03-04
11	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增中國郵政儲蓄銀行股份有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-03-09
12	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-04-15
13	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增上海華夏財富投資管理有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-04-22
14	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增深圳眾祿金融控股股份有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-05-10
15	關於停止支付寶基金專戶電子交易開戶及認購、申購、定期定額申購等業務的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-05-13

## §11 備查文件目錄

### 11.1 備查文件目錄

11.1.1 中國證監會核准基金興華轉型的文件；

11.1.2 《華夏興華混合型證券投資基金基金合同》；

11.1.3 《華夏興華混合型證券投資基金託管協議》；

11.1.4 法律意見書；

11.1.5 基金管理人業務資格批件、營業執照；

11.1.6 基金託管人業務資格批件、營業執照。

11.2 存放地點

備查文件存放於基金管理人及/或基金託管人的住所。

11.3 查閱方式

投資者可到基金管理人及/或基金託管人的住所免費查閱備查文件。在支付複印費後，投資者可在合理時間內取得備查文件的複製件或複印本。

華夏基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日



## §12 補充披露

## 補充披露 1：期末基金資產組合情況

名稱	數量（股）	公允價值（人民幣元）
<b>(1) 股票投資</b>		
<b>上市投資</b>		
<b>中國(100%)</b>		
神霧環保	3,699,855	76,143,015.90
華蘭生物	2,006,736	63,011,510.40
雲鋁股份	9,454,378	61,926,175.90
智雲股份	1,119,234	56,017,661.70
ST 生化	1,759,981	52,077,837.79
隆基股份	3,100,000	40,455,000.00
馳宏鋅鍺	3,936,600	39,247,902.00
美亞光電	1,679,181	38,688,330.24
華海藥業	1,552,675	37,761,056.00
台海核電	700,000	37,317,000.00
冀東水泥	3,467,241	36,752,754.60
東方航空	5,327,300	35,213,453.00
伊利股份	2,000,000	33,340,000.00
鐵漢生態	2,199,923	30,490,932.78
康美藥業	2,000,000	30,380,000.00
青島金王	949,893	25,371,642.03
隆華節能	2,170,886	24,270,505.48
金城股份	1,242,600	22,366,800.00
*ST 五稀	1,591,700	20,978,606.00
康盛股份	1,894,000	20,000,640.00
中來股份	500,000	18,340,000.00
新五豐	2,000,000	18,300,000.00
美克家居	1,343,571	17,479,858.71
上海貝嶺	1,000,000	17,370,000.00
章源鎢業	1,646,700	17,208,015.00
佛山照明	1,499,917	15,434,145.93
伊力特	1,000,000	15,040,000.00
華英農業	1,500,000	14,130,000.00
南方航空	2,000,000	14,120,000.00
應流股份	500,000	12,570,000.00
新洋豐	976,200	12,212,262.00
國農科技	300,000	11,049,000.00
大連國際	500,000	11,035,000.00
大亞科技	682,766	10,548,734.70

蘇交科	473,503	9,228,573.47
森遠股份	493,801	8,829,161.88
岳陽林紙	1,322,200	8,091,864.00
京漢股份	344,200	6,316,070.00
史丹利	446,300	5,511,805.00
中順潔柔	239,952	4,086,382.56
象嶼股份	279,100	2,869,148.00
華菱鋼鐵	310,211	1,225,333.45
中國核建	34,790	727,806.80
濟川藥業	26,300	676,962.00
久之洋	1,473	258,025.41
小康股份	8,662	206,761.94
中亞股份	1,873	187,150.16
四方冷鏈	2,793	151,995.06
玲瓏輪胎	9,862	128,008.76
威龍股份	2,808	117,823.68
百利科技	2,815	116,681.75
康普頓	1,590	101,585.10
上海滬工	1,263	76,664.10
三德科技	1,354	63,461.98
盛訊達	1,306	61,186.10
環球印務	1,080	47,131.20
哈森股份	2,372	34,394.00
洪匯新材	1,629	24,565.32
合誠股份	1,095	20,126.10
新宏泰	1,602	13,600.98
科大國創	926	9,306.30
豐元股份	971	5,631.80
<b>合計</b>		<b>1,035,835,047.06</b>
<b>(2)債券投資</b>		
<b>上市投資</b>		
<b>中國(100%)</b>		
12 豫交投 MTN4	100,000	10,499,000.00
<b>合計</b>		<b>10,499,000.00</b>
<b>總投資資產</b>		<b>1,046,334,047.06</b>
<b>銀行存款和結算備付金</b>		<b>195,196,206.02</b>
<b>其他各項資產</b>		<b>3,179,330.33</b>
<b>合計</b>		<b>1,244,709,583.41</b>

補充披露 2：投資組合變動表

序號	證券類別	佔基金資產淨值的 比例 (%) 2016 年 6 月 30 日	佔基金資產淨值的 比例 (%) 2015 年 12 月 31 日
1	股票	84.76	90.41
2	債券	0.86	0.71