

華夏興華混合型證券投資基金 2016 年年度報告

2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月二十九日

華夏興華混合型證券投資基金(“**本基金**”)

2016 年年度報告

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

二〇一七年三月二十九日

§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、準確性和完整性承擔個別及連帶的法律責任。本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 2017 年 3 月 27 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和運用基金資產，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。

本報告中的財務資料經審計，安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）為本基金作出了無保留意見的審計報告，請投資者注意閱讀。

本報告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金淨值表現及利潤分配情況.....	4
3.1 主要會計資料和財務指標.....	4
3.2 基金淨值表現.....	5
3.3 過去三年基金的利潤分配情況.....	7
§4 管理人報告.....	7
§5 託管人報告.....	13
§6 審計報告.....	14
§7 年度財務報表.....	16
7.1 資產負債表.....	16
7.2 利潤表.....	17
7.3 所有者權益（基金淨值）變動表.....	18
7.4 報表附注.....	20
§8 投資組合報告.....	44
8.1 期末基金資產組合情況.....	44
8.2 期末按行業分類的股票投資組合.....	44
8.3 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分析.....	45
8.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	48
8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合.....	50
8.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資分析.....	51
8.7 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分析.....	51
8.8 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分析.....	51
8.9 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分析.....	51
8.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明.....	52
8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明.....	52
8.12 投資組合報告附注.....	52
§9 基金份額持有人資訊.....	53
9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構.....	53
9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況.....	53
9.3 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.....	53
§10 開放式基金份額變動.....	54
§11 重大事件揭示.....	54
§12 備查文件目錄.....	58
§13 補充披露.....	60

§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	686,378,177.02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 基金管理人和基金託管人

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
	聯絡電話	400-818-6666	010-67595096
	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
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》
登載基金年度報告正文的管理人互聯網網址	www.ChinaAMC.com
基金年度報告備置地點	基金管理人和基金託管人的住所

2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
會計師事務所	安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）	北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層 01-12 室
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、基金淨值表現及利潤分配情況

3.1 主要會計資料和財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間資料和指標	2016 年	2015 年	2014 年
本期已實現收益	-152,198,190.54	775,052,707.88	252,683,101.03
本期利潤	-112,123,962.61	678,683,046.10	157,636,311.84
加權平均基金份額本期利潤	-0.1509	0.7572	0.1000
本期加權平均淨值利潤率	-8.95%	42.63%	8.51%
本期基金份額淨值增長率	-6.79%	51.47%	9.51%
3.1.2 期末資料和指標	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利潤	564,098,989.16	748,303,013.05	307,384,570.64
期末可供分配基金份額利潤	0.8218	0.9511	0.2847
期末基金資產淨值	1,216,280,842.88	1,495,892,395.33	1,355,116,165.91
期末基金份額淨值	1.772	1.901	1.255
3.1.3 累計期末指標	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份額累計淨值增長率	89.33%	103.11%	34.09%

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平要低於所列數字。

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
過去三個月	2.37%	0.80%	1.26%	0.50%	1.11%	0.30%
過去六個月	6.49%	0.79%	3.93%	0.53%	2.56%	0.26%
過去一年	-6.79%	1.74%	-6.63%	0.98%	-0.16%	0.76%
過去三年	54.62%	2.02%	36.54%	1.25%	18.08%	0.77%
自基金合同生效起至今	89.33%	1.89%	31.62%	1.20%	57.71%	0.69%

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12月31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。

3.2.3 自基金轉型以來基金每年淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

華夏興華混合型證券投資基金

自基金轉型以來基金每年淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的對比圖



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，合同生效當年按實際存續期計算，不按整個自然年度進行折算。

3.3 過去三年基金的利潤分配情況

本基金過去三年無利潤分配事項。

§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、廣州和青島設有分公司，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、首批基本養老保險基金投資管理人資格，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 12 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 7，華夏醫療健康混合 A 及華夏興華混合 A 分別在 58 隻偏股型基金（股票上限 95%）中排名第 10 和第 13，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 12；固定收益類產品中，華夏理財 30 天債券在 38 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。

2016 年，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，2016 年，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和服務體驗：（1）改進業務流程，客戶可通過網上交易系統自助辦理退款、重置密碼、上傳換卡資料等業務，還可自助辦理資產證明和蓋章對帳單，業務處理更加高效便捷；（2）增加交易管道，與滴滴出行合作推出滴滴金桔寶理財，並上線華夏財富網上交易系統，增加直銷定投通等功能，為客戶提供更多優惠便捷的理財管道，提高交易便利性；（3）開展“你定，我投”、“客戶個性化白皮書”、“2016 活期通年底曬帳單”、2016 北京馬拉松

等系列宣傳活動，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》、基金合同和其他有關法律法規，本著誠實信用、勤勉盡責、安全高效的原則管理和運用基金資產，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根據《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》等法規制定了《華夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通過科學、制衡的投資決策體系，加強交易分配環節的內部控制，並通過工作制度、流程和技術手段保證公平交易原則的實現。同時，通過監察稽核、事後分析和信息披露來保證公平交易過程和結果的監督。

4.3.2 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和組合，制定並嚴格遵守相應的制度和流程，通過系統和人工等方式在各環節嚴格控制交易公平執行。報告期內，本基金管理人嚴格執行了《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》和《華夏基金管理有限公司公平交易制度》的規定。

本基金管理人通過統計檢驗的方法對管理的不同投資組合，在不同時間窗下（1日內、3日內、5日內）的本年度同向交易價差進行了專項分析，未發現違反公平交易原則的異常情況。

4.3.3 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和業績表現的說明

4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

2016 年，財經事件頻發，國際上有美元加息進程一波三折、英國脫歐、特

朗普當選美國新總統等多項黑天鵝事件，國內亦有人民幣匯率受到貶值壓力、銀行理財規模快速膨脹、房地產價格快速上漲引致嚴格限購等等。實體經濟方面，雖然總需求不振的現象依然困擾全球，但庫存週期的波動亦使得國內實體經濟階段性溫和復蘇。A 股市場延續了 2015 年年中高點回落後的頹勢，全年上證指數跌幅達 12.3%，創業板指數跌幅更是高達 27.7%。具體而言，年初股票市場在熔斷機制的衝擊下大幅下跌，在 1 月內跌至年內低點 2638 點附近；其後，市場在穩健類藍籌股的帶動下走出溫和反彈的行情，11 月末上證指數回到 3300 點附近。板塊方面，低估值藍籌板塊表現相對穩健，高估值成長股板塊估值繼續收縮，前幾年牛市中估值膨脹較明顯的中小市值股票則全年持續承壓。

報告期內，本基金保持了相對穩定的股票投資比例，堅持以“自下而上”選股作為主要投資策略，淡化行業配置和股票倉位元擇時，個股集中度明顯提高。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份額淨值為 1.772 元，本報告期份額淨值增長率為-6.79%，同期業績比較基準增長率為-6.63%。

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，我們對 2017 年的市場抱有正面期望。我們認為中國宏觀經濟的韌性可能超出市場普遍預期。在本輪房地產市場的繁榮期間，企業家們保持了謹慎的擴張，並未像歷史上若干房地產繁榮時期那樣大手筆拿地。因此，我們認為由於房地產企業普遍財務狀態穩健，投資行為趨於理性，未來一個階段的實體經濟受房地產調控的影響亦可能優於悲觀者的預期，企業盈利仍將維持一段時間的復蘇。海外方面由於美國新政府的政策實施具有一定的不確定

性，目前還難以準確預期，需要密切觀察新總統上台後如何實施其執政綱領。我們認為 2017 年的股票市場會越來越多地受到實體經濟的影響，A 股市場波動可能加大。因此，在新的一年中，我們將保持對個股選擇的重要關注，並將適度加大組合的波段操作，以適應企業盈利節奏的變化。

綜合而言，我們將繼續“自下而上”精選個股，加大組合向優質資產集中的力度，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和每一份信任，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 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況

本報告期內，基金管理人持續加強合規管理、風險控制和監察稽核工作。在合規管理方面，公司制定了合規風險管理制度、風險隔離制度、員工違規違紀處理制度，修訂了保密管理制度和員工培訓制度，進一步完善合規制度建設；公司開展多種形式的合規培訓，重點加強了投資研究和基金銷售業務條線的合規教育，不斷提升員工的合規守法意識；強化事前事中合規風險管理，嚴格審核信息披露文件、基金宣傳推介材料，加強了對微信等新媒體宣傳材料的合規審核，防範各類合規風險。在風險管理方面，公司秉承全員風險管理的理念，採取事前防範、事中控制和事後監督等三階段工作，加強對日常投資運作的管理和監控，督促投研交易業務的合規開展；在監察稽核方面，公司定期和不定期開展多項內部稽核，對投資研究、基金交易、市場銷售、後台運作等關鍵業務和崗位進行檢查監督，促進公司業務合規運作、穩健經營。

報告期內，本基金管理人所管理的基金整體運作合法合規。本基金管理人

將繼續以風險控制為核心，堅持基金份額持有人利益優先的原則，提高監察稽核工作的科學性和有效性，切實保障基金安全、合規運作。

4.7 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和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作出報告。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和執行的專門機構，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。

4.8 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。

4.9 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、託管協議和其他有關規定，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、託管協議和其他有關規定，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關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 託管人對本年度報告中財務資訊等內容的真實、準確和完整發表意見

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 審計報告

安永華明(2017)審字第 60739337_B07 號

華夏興華混合型證券投資基金全體基金份額持有人：

我們審計了後附的華夏興華混合型證券投資基金財務報表，包括 2016 年 12 月 31 日的資產負債表和 2016 年度的利潤表和所有者權益（基金淨值）變動表以及財務報表附注。

6.1 管理層對財務報表的責任

編製和公允列報財務報表是基金管理人華夏基金管理有限公司的責任。這種

責任包括：（1）按照企業會計準則的規定編製財務報表，並使其實現公允反映；
（2）設計、執行和維護必要的內部控制，以使財務報表不存在由於舞弊或錯誤而導致的重大錯報。

6.2 註冊會計師的責任

我們的責任是在執行審計工作的基礎上對財務報表發表審計意見。我們按照中國註冊會計師審計準則的規定執行了審計工作。中國註冊會計師審計準則要求我們遵守中國註冊會計師職業道德守則，計劃和執行審計工作以對財務報表是否存在重大錯報獲取合理保證。

審計工作涉及實施審計程序，以獲取有關財務報表金額和披露的審計證據。選擇的審計程序取決於註冊會計師的判斷，包括對由於舞弊或錯誤導致的財務報表重大錯報風險的評估。在進行風險評估時，註冊會計師考慮與財務報表編製和公允列報相關的內部控制，以設計恰當的審計程序，但目的並非對內部控制的有效性發表意見。審計工作還包括評價基金管理人選用會計政策的恰當性和作出會計估計的合理性，以及評價財務報表的總體列報。

我們相信，我們獲取的審計證據是充分、適當的，為發表審計意見提供了基礎。

6.3 審計意見

我們認為，上述財務報表在所有重大方面按照企業會計準則的規定編製，公允反映了華夏興華混合型證券投資基金 2016 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2016 年度的經營成果和淨值變動情況。

安永華明會計師事務所（特殊普通合夥） 註冊會計師 湯駿 馬劍英

北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層 01-12 室

2017 年 3 月 10 日

§7 年度財務報表

7.1 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 12 月 31 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
資產：			
銀行存款	7.4.7.1	91,900,713.36	157,595,942.59
結算備付金		2,431,737.35	6,192,688.53
存出保證金		390,787.98	901,367.83
交易性金融資產	7.4.7.2	1,135,846,661.64	1,363,042,911.86
其中：股票投資		1,075,634,661.64	1,352,468,911.86
基金投資		-	-
債券投資		60,212,000.00	10,574,000.00
資產支持證券投資		-	-
貴金屬投資		-	-
衍生金融資產	7.4.7.3	-	-
買入返售金融資產	7.4.7.4	-	-
應收證券清算款		-	-
應收利息	7.4.7.5	1,259,901.33	56,619.06
應收股利		-	-
應收申購款		88,821.48	576,927.82
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	7.4.7.6	218,378.00	218,378.00
資產總計		1,232,137,001.14	1,528,584,835.69
負債和所有者權益	附注號	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
負債：			
短期借款		-	-

交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	7.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付證券清算款		-	-
應付贖回款		513,448.35	7,487,906.45
應付管理人報酬		1,566,312.40	1,920,551.31
應付託管費		261,052.08	320,091.89
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用	7.4.7.7	12,151,384.89	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	7.4.7.8	580,546.59	694,930.64
負債合計		15,856,158.26	32,692,440.36
所有者權益：			
實收基金	7.4.7.9	652,181,853.72	747,589,382.28
未分配利潤	7.4.7.10	564,098,989.16	748,303,013.05
所有者權益合計		1,216,280,842.88	1,495,892,395.33
負債和所有者權益總計		1,232,137,001.14	1,528,584,835.69

注：報告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份額淨值 1.772 元，基金份額總額 686,378,177.02 份。

7.2 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 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-81,346,756.59	723,969,729.73
1.利息收入		2,531,750.76	2,629,362.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,219,372.04	1,428,422.69
債券利息收入		1,245,808.41	1,200,940.21

資產支持證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		66,570.31	-
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		-124,081,257.93	816,914,374.23
其中：股票投資收益	7.4.7.12	-128,554,667.50	807,931,063.68
基金投資收益		-	-
債券投資收益	7.4.7.13	-	-79,480.00
資產支持證券投資收益	7.4.7.14	-	-
貴金屬投資收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	4,473,409.57	9,062,790.55
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	7.4.7.18	40,074,227.93	-96,369,661.78
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	7.4.7.19	128,522.65	795,654.38
減：二、費用		30,777,206.02	45,286,683.63
1.管理人報酬		18,780,392.76	23,729,241.75
2.託管費		3,130,065.60	3,954,873.66
3.銷售服務費		-	-
4.交易費用	7.4.7.20	8,651,174.61	17,365,452.53
5.利息支出		-	-
其中：賣出回購金融資產支出		-	-
6.其他費用	7.4.7.21	215,573.05	237,115.69
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		-112,123,962.61	678,683,046.10
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		-112,123,962.61	678,683,046.10

7.3 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 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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（本期利潤）	-	-112,123,962.61	-112,123,962.61
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）	-95,407,528.56	-72,080,061.28	-167,487,589.84
其中：1.基金申購款	92,129,395.56	71,411,382.14	163,540,777.70
2.基金贖回款	-187,536,924.12	-143,491,443.42	-331,028,367.54
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）	652,181,853.72	564,098,989.16	1,216,280,842.88
項目	上年度可比期間 2015年1月1日至2015年12月31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）	-	678,683,046.10	678,683,046.10
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）	-278,366,815.05	-259,540,001.63	-537,906,816.68
其中：1.基金申購款	386,462,235.26	347,056,995.43	733,519,230.69
2.基金贖回款	-664,829,050.31	-606,596,997.06	-1,271,426,047.37
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）	747,589,382.28	748,303,013.05	1,495,892,395.33

報表附注為財務報表的組成部分。

本報告 7.1 至 7.4 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

7.4 報表附注

7.4.1 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《關於核準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金字[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》和《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。

7.4.2 會計報表的編製基礎

本基金的財務報表按照財政部於 2006 年 2 月 15 日及其後頒佈和修訂的《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>》和中國證監會、中國基金業協會允許的如財務報表附注 7.4.4 所列示的基金行業實務操作的有關規定編製。

7.4.3 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

12 月 31 日的財務狀況以及 2016 年度的經營成果和基金淨值變動情況等有關資訊。

7.4.4 重要會計政策和會計估計

7.4.4.1 會計年度

本基金會計年度為西曆 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 記帳基本貨幣

本基金的記帳基本貨幣為人民幣。

7.4.4.3 金融資產和金融負債的分類

1、金融資產的分類

金融資產於初始確認時分類為：以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產、應收款項、可供出售金融資產及持有至到期投資。金融資產的分類取決於本基金對金融資產的持有意圖和持有能力。本基金目前暫無金融資產分類為可供出售金融資產及持有至到期投資。

本基金目前持有的股票投資、債券投資、資產支持證券投資和衍生工具分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。除衍生工具所產生的金融資產在資產負債表中以衍生金融資產列示外，以公允價值計量且其公允價值變動計入損益的金融資產在資產負債表中以交易性金融資產列示。

本基金持有的其他金融資產分類為應收款項，包括銀行存款、買入返售金融資產和各類應收款項等。應收款項是指在活躍市場中沒有報價、回收金額固定或可確定的非衍生金融資產。

2、金融負債的分類

金融負債於初始確認時分類為：以公允價值計量且其變動計入當期損益的

金融負債及其他金融負債。以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債包括交易性金融負債及衍生金融負債等。本基金持有的其他金融負債包括賣出回購金融資產款和各類應付款項等。

7.4.4.4 金融資產和金融負債的初始確認、後續計量和終止確認

金融資產或金融負債於本基金成為金融工具合同的一方時，於交易日按公允價值在資產負債表內確認。以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，取得時發生的相關交易費用計入當期損益；支付的價款中包含已宣告但尚未發放的現金股利、債券或資產支持證券起息日或上次除息日至購買日止的利息，單獨確認為應收項目。應收款項和其他金融負債的相關交易費用計入初始確認金額。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產及金融負債按照公允價值進行後續計量，應收款項和其他金融負債採用實際利率法，以攤餘成本進行後續計量。

當收取某項金融資產現金流量的合同權利已終止或該金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬已轉移時，終止確認該金融資產。終止確認的金融資產的成本按移動加權平均法於交易日結轉。

7.4.4.5 金融資產和金融負債的估值原則

本基金持有的股票投資、債券投資、資產支持證券投資和衍生工具按如下原則確定公允價值並進行估值：

- 1、存在活躍市場的金融工具按其估值日的市場交易價格確定公允價值；估值日無交易，但最近交易日後經濟環境未發生重大變化且證券發行機構未發生影響證券價格的重大事件的，按最近交易日的市場交易價格確定公允價值。

2、存在活躍市場的金融工具，如估值日無交易且最近交易日後經濟環境發生了重大變化或證券發行機構發生了影響證券價格的重大事件，參考類似投資品種的現行市價及重大變化等因素，調整最近交易市價以確定公允價值。

3、當金融工具不存在活躍市場，採用市場參與者普遍認同且被以往市場實際交易價格驗證具有可靠性的估值技術確定公允價值。估值技術包括參考熟悉情況並自願交易的各方最近進行的市場交易中使用的價格、參照實質上相同的其他金融工具的當前公允價值、現金流量折現法和期權定價模型等。採用估值技術時，盡可能最大程度使用市場參數，減少使用與本基金特定相關的參數。

7.4.4.6 金融資產和金融負債的抵銷

本基金持有的資產和承擔的負債基本為金融資產和金融負債。當本基金依法有權抵銷債權債務且交易雙方準備按淨額結算時，金融資產與金融負債按抵銷後的淨額在資產負債表中列示。

7.4.4.7 實收基金

實收基金為對外發行基金份額所募集的總金額在扣除損益平準金分攤部分後的餘額。對於曾經實施份額拆分或折算的基金，由於基金份額拆分或折算引起的實收基金份額變動於基金份額拆分日或基金份額折算日根據拆分前或折算前的基金份額數及確定的拆分或折算比例計算認列。由於申購和贖回引起的實收基金變動分別於基金申購確認日及基金贖回確認日認列。對於已開放轉換業務的基金，上述申購和贖回分別包括基金轉換所引起的轉入基金的實收基金增加和轉出基金的實收基金減少。

7.4.4.8 損益平準金

損益平準金包括已實現平準金和未實現平準金。已實現平準金指在申購或

贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未分配的已實現損益佔基金淨值比例計算的金額。未實現平準金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未實現損益佔基金淨值比例計算的金額。損益平準金於基金申購確認日或基金贖回確認日認列，並於期末全額轉入未分配利潤。

7.4.4.9 收入/（損失）的確認和計量

股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除由上市公司代扣代繳的個人所得稅後的淨額確認為投資收益。債券投資在持有期間應取得的按票面利率計算的利息扣除在適用情況下由債券發行企業代扣代繳的個人所得稅後的淨額確認為利息收入。資產支援證券在持有期間收到的款項，根據資產支援證券的預計收益率區分屬於資產支援證券投資本金部分和投資收益部分，將本金部分沖減資產支援證券投資成本，並將投資收益部分確認為利息收入。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產在持有期間的公允價值變動確認為公允價值變動損益；處置時其公允價值與初始確認金額之間的差額確認為投資收益，其中包括從公允價值變動損益結轉的公允價值累計變動額。

應收款項在持有期間確認的利息收入按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的按直線法近似計算。

7.4.4.10 費用的確認和計量

本基金的管理人報酬和託管費在費用涵蓋期間按基金合同約定的費率和計算方法逐日確認。

其他金融負債在持有期間確認的利息支出按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的按直線法近似計算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份額享有同等分配權。本基金收益以現金形式分配，但基金份額持有人可選擇現金紅利或將現金紅利按分紅權益再投資日的基金份額淨值自動轉為基金份額進行再投資。期末可供分配利潤指期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現收益的孰低數。

經宣告的擬分配基金收益於分紅除權日從所有者權益轉出。

7.4.4.12 其他重要的會計政策和會計估計

根據本基金的估值原則和中國證監會允許的基金行業估值實務操作，本基金確定以下類別股票投資和債券投資的公允價值時採用的估值方法及其關鍵假設如下：

1、對於特殊事項停牌股票，根據中國證監會公告[2008]38 號《關於進一步規範證券投資基金估值業務的指導意見》，本基金參考《中國證券業協會基金估值工作小組關於停牌股票估值的參考方法》對重大影響基金資產淨值的特殊事項停牌股票進行估值。

2、對於在鎖定期內的非公開發行股票，根據中國證監會證監會計字[2007]21 號《關於證券投資基金執行〈企業會計準則〉估值業務及份額淨值計價有關事項的通知》之附件《非公開發行有明確鎖定期股票的公允價值的確定方法》，若在證券交易所掛牌的同一股票的市場交易收盤價低於非公開發行股票的初始投資成本，按估值日證券交易所掛牌的同一股票的市場交易收盤價估值；若在證券交易所掛牌的同一股票的市場交易收盤價高於非公開發行股票的初始投資成本，按鎖定期內已經過交易天數佔鎖定期內總交易天數的比例將兩者之間差價的一部分確認為估值增值。

3、在銀行間同業市場交易的債券品種，根據中國證監會證監會計字

[2007]21 號《關於證券投資基金執行<企業會計準則>估值業務及份額淨值計價有關事項的通知》採用估值技術確定公允價值。本基金持有的銀行間同業市場債券按現金流量折現法估值，具體估值模型、參數及結果由中央國債登記結算有限責任公司獨立提供。

4、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、資產支援證券和私募債券除外)，於 2015 年 3 月 20 日起按照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。

7.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

7.4.5.1 會計政策變更的說明

本基金本報告期無會計政策變更。

7.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期無會計估計變更。

7.4.5.3 差錯更正的說明

本基金本報告期無重大會計差錯的內容和更正金額。

7.4.6 稅項

根據財稅[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征增值稅試點的通知》、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》、財稅[2016]70 號《財政部、國家稅務總局關於金融機構同業往來等增值稅政策的補充通知》、財稅[2015]125 號《財政部、國家稅務總局、證監會關於內地與香港基金互認有關稅收政策的通知》及其他相關財稅法規和實務操作，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、債券的差價收入免征營業稅或增值稅，暫不徵收企業所得稅。

3、存款利息收入不徵收增值稅。

4、國債、地方政府債利息收入，金融同業往來利息收入免征增值稅。

5、對基金取得的債券的利息收入及其他收入，暫不徵收企業所得稅。

6、對基金取得的股票的股息、紅利收入，由上市公司在向基金派發股息、紅利收入時代扣代繳個人所得稅，暫不徵收企業所得稅。其中對內地投資者取得上述收入按照 20% 代扣代繳個人所得稅，應納稅所得額按如下方式確認：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，暫免徵收個人所得稅；對香港市場投資者取得的股息、紅利收入按照 10% 的稅率代扣所得稅。

7、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。

8、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、企業所得稅和個人所得稅。

7.4.7 重要財務報表項目的說明

7.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	91,900,713.36	157,595,942.59
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合計	91,900,713.36	157,595,942.59

7.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年12月31日			
	成本	公允價值	公允價值變動	
股票	998,882,488.05	1,075,634,661.64	76,752,173.59	
貴金屬投資-金交所 黃金合約	-	-	-	
債券	交易所市場	-	-	
	銀行間市場	60,001,947.95	60,212,000.00	210,052.05
	合計	60,001,947.95	60,212,000.00	210,052.05
資產支持證券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合計	1,058,884,436.00	1,135,846,661.64	76,962,225.64	
項目	上年度末 2015年12月31日			
	成本	公允價值	公允價值變動	
股票	1,316,154,566.20	1,352,468,911.86	36,314,345.66	
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	10,574,000.00	573,652.05

合計	10,000,347.95	10,574,000.00	573,652.05
資產支持證券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合計	1,326,154,914.15	1,363,042,911.86	36,887,997.71

7.4.7.3 衍生金融資產/負債

無。

7.4.7.4 買入返售金融資產

7.4.7.4.1 各項買入返售金融資產期末餘額

無。

7.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

無。

7.4.7.5 應收利息

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
應收活期存款利息	19,499.09	32,287.86
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	1,203.73	3,065.37
應收債券利息	1,239,005.13	20,819.67
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	193.38	446.16
合計	1,259,901.33	56,619.06

7.4.7.6 其他資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
----	--------------------	---------------------

其他應收款	218,378.00	218,378.00
待攤費用	-	-
合計	218,378.00	218,378.00

7.4.7.7 應付交易費用

單位：人民幣元

項目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市場應付交易費用	12,150,610.89	21,485,546.12
銀行間市場應付交易費用	774.00	-
合計	12,151,384.89	21,485,546.12

7.4.7.8 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
應付券商交易單元保證金	500,000.00	500,000.00
應付贖回費	546.59	24,930.64
預提費用	80,000.00	170,000.00
合計	580,546.59	694,930.64

7.4.7.9 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 12 月 31 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	96,956,136.99	92,129,395.56
本期贖回（以“-”號填列）	-197,357,384.51	-187,536,924.12
本期末	686,378,177.02	652,181,853.72

7.4.7.10 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	-152,198,190.54	40,074,227.93	-112,123,962.61

本期基金份額交易產生的變動數	-85,403,255.22	13,323,193.94	-72,080,061.28
其中：基金申購款	88,332,464.21	-16,921,082.07	71,411,382.14
基金贖回款	-173,735,719.43	30,244,276.01	-143,491,443.42
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	612,482,541.79	-48,383,552.63	564,098,989.16

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
活期存款利息收入	1,172,110.56	1,303,924.06
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	39,202.59	109,551.94
其他	8,058.89	14,946.69
合計	1,219,372.04	1,428,422.69

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
賣出股票成交總額	2,934,678,657.47	6,004,259,406.22
減：賣出股票成本總額	3,063,233,324.97	5,196,328,342.54
買賣股票差價收入	-128,554,667.50	807,931,063.68

7.4.7.13 債券投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成交總額	-	72,700,483.69
減：賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成本總額	-	70,125,150.00
減：應收利息總額	-	2,654,813.69

買賣債券差價收入	-	-79,480.00
----------	---	------------

7.4.7.14 資產支持證券投資收益

無。

7.4.7.15 貴金屬投資收益

7.4.7.15.1 貴金屬投資收益項目構成

無。

7.4.7.15.2 貴金屬投資——買賣貴金屬差價收入

無。

7.4.7.15.3 貴金屬投資——贖回差價收入

無。

7.4.7.15.4 貴金屬投資——申購差價收入

無。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

無。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

無。

7.4.7.17 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
股票投資產生的股利收益	4,473,409.57	9,062,790.55
基金投資產生的股利收益	-	-
合計	4,473,409.57	9,062,790.55

7.4.7.18 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
1.交易性金融資產	40,074,227.93	-96,369,661.78
——股票投資	40,437,827.93	-96,981,811.78
——債券投資	-363,600.00	612,150.00
——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	40,074,227.93	-96,369,661.78

7.4.7.19 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
基金贖回費收入	128,522.65	795,654.38
其他	-	-
合計	128,522.65	795,654.38

7.4.7.20 交易費用

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
交易所市場交易費用	8,650,899.61	17,365,052.53
銀行間市場交易費用	275.00	400.00
合計	8,651,174.61	17,365,452.53

7.4.7.21 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
審計費用	80,000.00	90,000.00
信息披露費	80,000.00	80,000.00
銀行間帳戶維護費	36,000.00	36,000.00
銀行費用	18,173.05	30,065.69
其他	1,400.00	1,050.00
合計	215,573.05	237,115.69

7.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

7.4.8.1 或有事項

截至資產負債表日，本基金無或有事項。

7.4.8.2 資產負債表日後事項

財政部、國家稅務總局於 2017 年 1 月 6 日頒佈的《關於資管產品增值稅政策有關問題的補充通知》(財稅[2017]2 號)，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以後，資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人，按照現行規定繳納增值稅。對資管產品在 2017 年 7 月 1 日前運營過程中發生的增值稅應稅行為，未繳納增值稅的，不再繳納；已繳納增值稅的，已納稅額從資管產品管理人以後月份的增值稅應納稅額中抵減。資管產品運營過程中發生增值稅應稅行為的具體徵收管理辦法，由國家稅務總局另行制定。上述稅收政策對本基金截至本財務報表批准報出日止的財務狀況和經營成果無影響。

上述通知是對財政部、國家稅務總局於 2016 年 12 月 21 日頒佈的《關於明確金融房地產開發 教育輔助服務等增值稅政策的通知》(財稅[2016]140 號)的補充，該通知要求資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人，自 2016 年 5 月 1 日起執行。

7.4.9 關聯方關係

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
中國建設銀行股份有限公司(“中國建設銀行”)	基金託管人
中信證券股份有限公司(“中信證券”)	基金管理人的股東
山東省農村經濟開發投資公司	基金管理人的股東
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股東
青島海鵬科技投資有限公司	基金管理人的股東
南方工業資產管理有限責任公司	基金管理人的股東

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。

7.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

7.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

無。

7.4.10.1.2 權證交易

無。

7.4.10.1.3 債券交易

無。

7.4.10.1.4 債券回購交易

無。

7.4.10.1.5 應支付關聯方的佣金

無。

7.4.10.2 關聯方報酬

7.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日

當期發生的基金應支付的管理費	18,780,392.76	23,729,241.75
其中：支付銷售機構的客戶維護費	1,335,276.93	1,383,013.00

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。

7.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
當期發生的基金應支付的託管費	3,130,065.60	3,954,873.66

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。

7.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

無。

7.4.10.4 各關聯方投資本基金的情況

7.4.10.4.1 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	-	6,816,632.58

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	124,156,009.58
期末持有的基金份額佔基金總份額比例	18.09%	15.78%

7.4.10.4.2 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

無。

7.4.10.5 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 2016年1月1日至 2016年12月31日		上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31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	91,900,713.36	1,172,110.56	157,595,942.59	1,303,924.06

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。

7.4.10.6 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

無。

7.4.11 利潤分配情況

本基金本報告期無利潤分配事項。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限證券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601375	中原證券	2016-12-20	2017-01-03	新發流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鳥	2016-12-29	2017-01-09	新發流	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-

				通受限						
300583	賽托生物	2016-12-29	2017-01-06	新發流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603228	景旺電子	2016-12-28	2017-01-06	新發流通受限	23.16	23.16	2,182	50,535.12	50,535.12	-
603689	皖天然氣	2016-12-30	2017-01-10	新發流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽飾	2016-12-27	2017-01-05	新發流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龍股份	2016-12-30	2017-01-10	新發流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天鐵股份	2016-12-28	2017-01-05	新發流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	華統股份	2016-12-29	2017-01-10	新發流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新發流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	華正新材	2016-12-26	2017-01-03	新發流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交運	2016-12-27	2017-01-05	新發流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美聯新材	2016-12-26	2017-01-04	新發流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	萬里馬	2016-12-30	2017-01-10	新發流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新發流通受限	4.94	4.94	1,104	5,453.76	5,453.76	-

7.4.12.2 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
603986	兆易創新	2016-09-19	重大事項	177.97	2017-03-13	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-
300537	廣信材料	2016-10-12	重大事項	48.79	2017-01-13	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-

7.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

7.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

無。

7.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

無。

7.4.13 金融工具風險及管理

7.4.13.1 風險管理政策和組織架構

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、風險管理部和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、投資決策委員會和風險管理委員會，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和定量分析的方法，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、模型和日常的量化報告，參考壓力測試結果，確定風險損失的限度和相應置信程度，及時對各種風險進行監督、檢查和評估，並制定相應決策，將風險控制在預期可承受的範圍內。

7.4.13.2 信貸風險

信貸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，債券發行人信貸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貸分析團隊建立了內部評級體系和交易對手庫，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貸風險。

7.4.13.3 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“7.4.12 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。

7.4.13.4 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敏感性指標來衡量市場風險。

7.4.13.4.1 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。截至本期末，本基金持有極少量債券資產，因此市場利率的變動對於本基金資產淨值無重大影響。

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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他價格風險

其他價格風險為除市場利率和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和分析，以對風險進行跟蹤和控制。

7.4.13.4.3.1 其他價格風險敞口

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2016 年 12 月 31 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	1,075,634,661.64	88.44	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	1,075,634,661.64	88.44	1,352,468,911.86	90.41

7.4.13.4.3.2 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。		
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 12 月 31 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	+5%	40,863,360.80	82,061,051.23
	-5%	-40,863,360.80	-82,061,051.23

7.4.14 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 各層次金融工具公允價值

截至 2016 年 12 月 31 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 1,075,634,661.64 元，第二層次的餘額為 60,212,000.00 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。）

7.4.14.3 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，本基金將相關股票和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、資產支持證券和私募債券除外)，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。

7.4.14.4 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。

§8 投資組合報告

8.1 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	1,075,634,661.64	87.30
	其中：股票	1,075,634,661.64	87.30
2	固定收益投資	60,212,000.00	4.89
	其中：債券	60,212,000.00	4.89
	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	銀行存款和結算備付金合計	94,332,450.71	7.66
7	其他各項資產	1,957,888.79	0.16
8	合計	1,232,137,001.14	100.00

8.2 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	27,421,042.00	2.25
B	採礦業	60,327,504.43	4.96
C	製造業	896,953,575.42	73.75
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	33,411,927.26	2.75
E	建築業	366,171.15	0.03

F	批發和零售業	19,963,818.35	1.64
G	交通運輸、倉儲和郵政業	9,458.68	0.00
H	住宿和餐飲業	-	-
I	資訊傳輸、軟體和資訊技術服務業	804,340.61	0.07
J	金融業	708,431.70	0.06
K	房地產業	18,490,238.34	1.52
L	租賃和商務服務業	3,390,409.30	0.28
M	科學研究和技術服務業	137,744.40	0.01
N	水利、環境和公共設施管理業	-	-
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	-	-
R	文化、體育和娛樂業	-	-
S	綜合	13,650,000.00	1.12
	合計	1,075,634,661.64	88.44

8.3 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分析

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	300097	智雲股份	1,917,334	105,089,076.54	8.64
2	300156	神霧環保	3,699,855	92,533,373.55	7.61
3	000820	神霧節能	2,819,978	81,497,364.20	6.70
4	000403	ST 生化	1,759,981	57,744,976.61	4.75
5	002366	台海核電	1,000,000	53,620,000.00	4.41
6	002450	康得新	2,789,200	53,301,612.00	4.38
7	600518	康美藥業	2,600,000	46,410,000.00	3.82
8	002387	黑牛食品	2,335,200	40,655,832.00	3.34
9	600276	恒瑞醫藥	760,900	34,620,950.00	2.85
10	002043	兔寶寶	2,894,151	33,485,327.07	2.75
11	600452	涪陵電力	800,720	33,374,009.60	2.74
12	600566	濟川藥業	976,536	30,526,515.36	2.51
13	600782	新鋼股份	8,431,500	28,161,210.00	2.32
14	002470	金正大	3,000,000	23,700,000.00	1.95
15	000902	新洋豐	2,000,000	22,520,000.00	1.85
16	002529	海源機械	999,975	21,139,471.50	1.74
17	600871	石化油服	5,000,000	20,500,000.00	1.69

18	002353	傑瑞股份	1,000,000	20,300,000.00	1.67
19	600271	航天信息	1,000,000	19,950,000.00	1.64
20	600759	洲際油氣	1,999,906	19,639,076.92	1.61
21	601607	上海醫藥	1,000,000	19,560,000.00	1.61
22	603515	歐普照明	500,000	19,255,000.00	1.58
23	002064	華峰氨綸	3,324,600	18,252,054.00	1.50
24	002037	久聯發展	999,929	17,118,784.48	1.41
25	600048	保利地產	1,614,266	14,738,248.58	1.21
26	002321	華英農業	1,300,000	13,923,000.00	1.14
27	000881	大連國際	500,000	13,650,000.00	1.12
28	002299	聖農發展	636,100	13,498,042.00	1.11
29	300410	正業科技	229,100	12,366,818.00	1.02
30	600521	華海藥業	552,675	12,175,430.25	1.00
31	601808	中海油服	926,100	11,881,863.00	0.98
32	002662	京威股份	692,485	11,391,378.25	0.94
33	002100	天康生物	1,000,000	8,970,000.00	0.74
34	600984	建設機械	999,903	8,739,152.22	0.72
35	600328	蘭太實業	654,517	8,587,263.04	0.71
36	002068	黑貓股份	1,000,000	8,380,000.00	0.69
37	002554	惠博普	1,000,000	8,170,000.00	0.67
38	600376	首開股份	317,696	3,751,989.76	0.31
39	600057	象嶼股份	279,100	3,209,650.00	0.26
40	002371	七星電子	81,994	2,181,040.40	0.18
41	600909	華安證券	39,964	501,548.20	0.04
42	002821	凱萊英	2,293	329,022.57	0.03
43	603888	新華網	3,212	272,634.56	0.02
44	603556	海興電力	6,053	272,142.88	0.02
45	603160	匯頂科技	2,625	269,692.50	0.02
46	600996	貴廣網路	12,500	234,875.00	0.02
47	603986	兆易創新	1,133	201,640.01	0.02
48	603708	家家悅	5,874	185,794.62	0.02
49	002818	富森美	3,082	180,759.30	0.01
50	603258	電魂網路	2,783	166,145.10	0.01
51	300558	貝達藥業	2,172	160,293.60	0.01
52	603900	通靈珠寶	4,064	156,464.00	0.01
53	300569	天能重工	1,314	131,452.56	0.01
54	603313	恒康家居	3,371	129,412.69	0.01

55	603007	花王股份	2,424	128,884.08	0.01
56	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
57	002822	中裝建設	4,097	118,362.33	0.01
58	300568	星源材質	1,310	107,262.80	0.01
59	601375	中原證券	26,695	106,780.00	0.01
60	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.01
61	603323	吳江銀行	6,475	100,103.50	0.01
62	300570	太辰光	1,810	100,093.00	0.01
63	603727	博邁科	2,027	96,343.31	0.01
64	300565	科信技術	2,382	94,517.76	0.01
65	002823	凱中精密	1,947	89,951.40	0.01
66	603298	杭叉集團	3,641	88,403.48	0.01
67	002820	桂發祥	1,772	86,934.32	0.01
68	603977	國泰集團	3,010	82,624.50	0.01
69	603987	康得萊	2,503	80,821.87	0.01
70	603878	武進不鏽	2,000	80,000.00	0.01
71	603667	五洲新春	2,404	79,548.36	0.01
72	603060	國檢集團	2,201	77,849.37	0.01
73	300552	萬集科技	1,349	76,785.08	0.01
74	603660	蘇州科達	2,353	75,813.66	0.01
75	603928	興業股份	2,670	74,359.50	0.01
76	603585	蘇利股份	1,041	72,578.52	0.01
77	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
78	603577	匯金通	2,460	69,642.60	0.01
79	603336	宏輝果蔬	1,471	69,239.97	0.01
80	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
81	603877	太平鳥	3,180	67,734.00	0.01
82	603203	快克股份	1,048	65,929.68	0.01
83	002813	路暢科技	1,296	65,888.64	0.01
84	300583	賽托生物	1,582	63,738.78	0.01
85	002819	東方中科	1,293	61,559.73	0.01
86	002827	高爭民爆	2,059	60,905.22	0.01
87	603859	能科股份	1,121	59,895.03	0.00
88	603033	三維股份	1,160	59,821.20	0.00
89	002826	易明醫藥	2,181	57,316.68	0.00
90	603416	信捷電氣	1,076	53,886.08	0.00
91	002825	納爾股份	1,139	53,521.61	0.00

92	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.00
93	603633	徠木股份	1,258	51,590.58	0.00
94	603228	景旺電子	2,182	50,535.12	0.00
95	300537	廣信材料	1,024	49,960.96	0.00
96	603559	中通國脈	899	48,447.11	0.00
97	002833	弘亞數控	2,743	48,331.66	0.00
98	002817	黃山膠囊	839	47,797.83	0.00
99	603389	亞振家居	1,963	47,327.93	0.00
100	002816	和科達	1,000	47,280.00	0.00
101	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
102	603319	湘油泵	721	40,736.50	0.00
103	002828	貝肯能源	1,042	40,221.20	0.00
104	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
105	603689	皖天然氣	4,818	37,917.66	0.00
106	300582	英飛特	1,359	35,157.33	0.00
107	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
108	002835	同為股份	1,126	24,220.26	0.00
109	603035	常熟汽飾	2,316	24,179.04	0.00
110	603266	天龍股份	1,562	22,852.06	0.00
111	300587	天鐵股份	1,438	20,290.18	0.00
112	603929	亞翔集成	2,193	15,592.23	0.00
113	002840	華統股份	1,814	11,881.70	0.00
114	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
115	603186	華正新材	1,874	10,063.38	0.00
116	603032	德新交運	1,628	9,458.68	0.00
117	300586	美聯新材	1,006	9,355.80	0.00
118	300591	萬里馬	2,397	7,358.79	0.00
119	300588	熙菱信息	1,104	5,453.76	0.00
120	002616	長青集團	100	1,994.00	0.00

8.4 報告期內股票投資組合的重大變動

8.4.1 累計買入金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票分析

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	300097	智雲股份	89,627,450.72	5.99

2	002007	華蘭生物	54,577,693.80	3.65
3	000820	神霧節能	53,959,705.33	3.61
4	002366	台海核電	51,665,292.68	3.45
5	002690	美亞光電	51,455,944.04	3.44
6	000807	雲鋁股份	49,382,388.26	3.30
7	000709	河鋼股份	49,360,940.10	3.30
8	002450	康得新	48,477,365.85	3.24
9	000895	雙匯發展	48,251,963.82	3.23
10	002387	黑牛食品	46,834,378.00	3.13
11	600452	涪陵電力	46,288,259.07	3.09
12	600497	馳宏鋅鍺	43,553,954.47	2.91
13	000902	新洋豐	41,726,536.87	2.79
14	600518	康美藥業	40,678,214.37	2.72
15	002043	兔寶寶	39,343,834.76	2.63
16	601012	隆基股份	39,143,292.57	2.62
17	600115	東方航空	38,041,993.00	2.54
18	000778	新興鑄管	37,853,503.24	2.53
19	002037	久聯發展	36,819,495.15	2.46
20	000401	冀東水泥	35,670,107.44	2.38
21	600276	恒瑞醫藥	33,864,396.78	2.26
22	000655	金嶺礦業	33,662,965.35	2.25
23	002094	青島金王	33,224,706.85	2.22
24	600887	伊利股份	32,398,380.78	2.17
25	000937	冀中能源	31,664,183.92	2.12
26	300197	鐵漢生態	31,282,312.92	2.09
27	600782	新鋼股份	30,644,198.47	2.05
28	600566	濟川藥業	30,159,142.45	2.02

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。

8.4.2 累計賣出金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票分析

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	000807	雲鋁股份	118,236,712.78	7.90
2	002007	華蘭生物	72,977,935.30	4.88
3	300077	國民技術	61,121,302.18	4.09

4	600559	老白乾酒	59,743,016.23	3.99
5	002630	華西能源	54,453,772.46	3.64
6	002299	聖農發展	53,412,462.62	3.57
7	600497	馳宏鋅鍺	53,180,816.60	3.56
8	002601	佰利聯	49,760,418.24	3.33
9	002690	美亞光電	45,019,564.91	3.01
10	000895	雙匯發展	44,944,017.99	3.00
11	300202	聚龍股份	44,643,245.29	2.98
12	601012	隆基股份	42,916,689.41	2.87
13	000709	河鋼股份	42,709,633.15	2.86
14	600096	雲天化	42,285,138.33	2.83
15	000541	佛山照明	40,090,198.69	2.68
16	002094	青島金王	38,519,134.03	2.57
17	600115	東方航空	36,542,443.71	2.44
18	000401	冀東水泥	35,860,545.95	2.40
19	000778	新興鑄管	33,780,319.54	2.26
20	600887	伊利股份	33,414,112.03	2.23
21	002271	東方雨虹	32,474,072.46	2.17
22	600325	華髮股份	31,624,637.52	2.11
23	000596	古井貢酒	31,460,340.14	2.10
24	000910	大亞聖象	30,808,597.77	2.06
25	000655	金嶺礦業	29,968,747.46	2.00

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。

8.4.3 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	2,745,961,246.82
賣出股票收入（成交）總額	2,934,678,657.47

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。

8.5 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	50,000,000.00	4.11
	其中：政策性金融債	50,000,000.00	4.11
4	企業債券	-	-
5	企業短期融資券	-	-
6	中期票據	10,212,000.00	0.84
7	可轉債（可交換債）	-	-
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	60,212,000.00	4.95

8.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資分析

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	160401	16 農發 01	500,000	50,000,000.00	4.11
2	1282544	12 豫交投 MTN4	100,000	10,212,000.00	0.84
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 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分析

本基金本報告期末未持有資產支持證券。

8.8 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分析

本基金本報告期末未持有貴金屬。

8.9 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分析

本基金本報告期末未持有權證。

8.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明

8.10.1 報告期末本基金投資的股指期貨持倉和損益分析

本基金本報告期末無股指期貨投資。

8.10.2 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。

8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

8.11.1 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。

8.11.2 報告期末本基金投資的國債期貨持倉和損益分析

本基金本報告期末無國債期貨投資。

8.11.3 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。

8.12 投資組合報告附注

8.12.1 2016 年 8 月 18 日台海核電收到了深圳證券交易所下發的《關於對台海瑪努爾核電設備股份有限公司及相關當事人給予通報批評處分的決定》。本基金投資該股票的投資決策程序符合相關法律法規的要求。

8.12.2 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。

8.12.3 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	390,787.98
2	應收證券清算款	-
3	應收股利	-
4	應收利息	1,259,901.33

5	應收申購款	88,821.48
6	其他應收款	218,378.00
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	1,957,888.79

8.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券分析

本基金本報告期末未持有處於轉股期的可轉換債券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

本基金本報告期末前十名股票中不存在流通受限情況。

8.12.6 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，分項之和與合計項之間可能存在尾數差異。

§9 基金份額持有人資訊

9.1 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
41,074	16,710.77	142,538,654.85	20.77%	543,839,522.17	79.23%

9.2 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	590,782.02	0.09%

9.3 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、基金投資和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

§10 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	96,956,136.99
減：本報告期基金總贖回份額	197,357,384.51
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	686,378,177.02

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 為基金進行審計的會計師事務所情況

本基金本報告期應支付給安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）的報酬為 80,000 元人民幣。截至本報告期末，該事務所已向本基金提供 9 年的審計服務。

11.6 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。

11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

11.7.1 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	1,588,411,782.90	28.00%	1,479,285.86	28.38%	-
申萬宏源證券	1	990,335,845.54	17.45%	922,293.34	17.69%	-
招商證券	1	982,398,056.53	17.31%	914,907.83	17.55%	-
國都證券	1	734,106,063.80	12.94%	683,673.85	13.12%	-
廣發證券	3	679,854,159.87	11.98%	561,999.72	10.78%	-
中金公司	1	402,063,245.64	7.09%	374,443.15	7.18%	-
中信建投證券	1	233,307,537.44	4.11%	217,280.39	4.17%	-
國泰君安證券	1	63,369,243.65	1.12%	59,015.59	1.13%	-

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、公司和證券市場研究報告，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，能及時提供準確的資訊資訊和服務。

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和研究實力進行評估，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、國元證券、中國銀河證券、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。

11.7.2 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
-	-	-	-	-

11.8 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
16	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-07-02
17	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	2016-07-02
18	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增珠海盈米財富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	2016-07-07
19	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富濟財富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	2016-08-17
20	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金在萬聯證券開通申購、贖回、轉換、定期定額申購業務的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-08-25
21	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增北京匯成基金銷售有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-08-26
22	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增大泰金石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	2016-08-31
23	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	2016-09-20

24	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增中證金牛（北京）投資諮詢有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-10-25
25	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增泰誠財富基金銷售（大連）有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-11-02
26	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長量基金銷售投資顧問有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-11-16
27	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	2016-11-18
28	關於華夏基金管理有限公司旗下部分開放式基金在華西證券股份有限公司開通申購、贖回等業務的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-11-18
29	關於旗下部分開放式基金新增北京新浪倉石基金銷售有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-12-08
30	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增北京蛋捲基金銷售有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-12-23

§12 備查文件目錄

12.1 備查文件目錄

12.1.1 中國證監會核準基金興華轉型的文件；

12.1.2 《華夏興華混合型證券投資基金基金合同》；

12.1.3 《華夏興華混合型證券投資基金託管協議》；

12.1.4 法律意見書；

12.1.5 基金管理人業務資格批件、營業執照；

12.1.6 基金託管人業務資格批件、營業執照。

12.2 存放地點

備查文件存放於基金管理人和/或基金託管人的住所。

12.3 查閱方式

投資者可到基金管理人和/或基金託管人的住所免費查閱備查文件。在支付手續費後，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

二〇一七年三月二十九日

§13 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）
(1) 股票投資		
上市投資		
中國(100%)		
智雲股份	1,917,334	105,089,076.54
神霧環保	3,699,855	92,533,373.55
神霧節能	2,819,978	81,497,364.20
ST 生化	1,759,981	57,744,976.61
台海核電	1,000,000	53,620,000.00
康得新	2,789,200	53,301,612.00
康美藥業	2,600,000	46,410,000.00
黑牛食品	2,335,200	40,655,832.00
恒瑞醫藥	760,900	34,620,950.00
兔寶寶	2,894,151	33,485,327.07
涪陵電力	800,720	33,374,009.60
濟川藥業	976,536	30,526,515.36
新鋼股份	8,431,500	28,161,210.00
金正大	3,000,000	23,700,000.00
新洋豐	2,000,000	22,520,000.00
海源機械	999,975	21,139,471.50
石化油服	5,000,000	20,500,000.00
傑瑞股份	1,000,000	20,300,000.00
航天信息	1,000,000	19,950,000.00
洲際油氣	1,999,906	19,639,076.92
上海醫藥	1,000,000	19,560,000.00
歐普照明	500,000	19,255,000.00
華峰氨綸	3,324,600	18,252,054.00
久聯發展	999,929	17,118,784.48
保利地產	1,614,266	14,738,248.58
華英農業	1,300,000	13,923,000.00
大連國際	500,000	13,650,000.00
聖農發展	636,100	13,498,042.00
正業科技	229,100	12,366,818.00
華海藥業	552,675	12,175,430.25
中海油服	926,100	11,881,863.00
京威股份	692,485	11,391,378.25
天康生物	1,000,000	8,970,000.00
建設機械	999,903	8,739,152.22

蘭太實業	654,517	8,587,263.04
黑貓股份	1,000,000	8,380,000.00
惠博普	1,000,000	8,170,000.00
首開股份	317,696	3,751,989.76
象嶼股份	279,100	3,209,650.00
七星電子	81,994	2,181,040.40
華安證券	39,964	501,548.20
凱萊英	2,293	329,022.57
新華網	3,212	272,634.56
海興電力	6,053	272,142.88
匯頂科技	2,625	269,692.50
貴廣網路	12,500	234,875.00
兆易創新	1,133	201,640.01
家家悅	5,874	185,794.62
富森美	3,082	180,759.30
電魂網路	2,783	166,145.10
貝達藥業	2,172	160,293.60
通靈珠寶	4,064	156,464.00
天能重工	1,314	131,452.56
恒康家居	3,371	129,412.69
花王股份	2,424	128,884.08
百合花	3,762	123,167.88
中裝建設	4,097	118,362.33
星源材質	1,310	107,262.80
中原證券	26,695	106,780.00
森特股份	4,293	103,332.51
吳江銀行	6,475	100,103.50
太辰光	1,810	100,093.00
博邁科	2,027	96,343.31
科信技術	2,382	94,517.76
凱中精密	1,947	89,951.40
杭叉集團	3,641	88,403.48
桂發祥	1,772	86,934.32
國泰集團	3,010	82,624.50
康得萊	2,503	80,821.87
武進不鏽	2,000	80,000.00
五洲新春	2,404	79,548.36
國檢集團	2,201	77,849.37
萬集科技	1,349	76,785.08
蘇州科達	2,353	75,813.66
興業股份	2,670	74,359.50
蘇利股份	1,041	72,578.52
比音勒芬	1,158	70,290.60

匯金通	2,460	69,642.60
宏輝果蔬	1,471	69,239.97
日月股份	1,652	68,805.80
太平鳥	3,180	67,734.00
快克股份	1,048	65,929.68
路暢科技	1,296	65,888.64
賽托生物	1,582	63,738.78
東方中科	1,293	61,559.73
高爭民爆	2,059	60,905.22
能科股份	1,121	59,895.03
三維股份	1,160	59,821.20
易明醫藥	2,181	57,316.68
信捷電氣	1,076	53,886.08
納爾股份	1,139	53,521.61
如通股份	2,114	51,771.86
徠木股份	1,258	51,590.58
景旺電子	2,182	50,535.12
廣信材料	1,024	49,960.96
中通國脈	899	48,447.11
弘亞數控	2,743	48,331.66
黃山膠囊	839	47,797.83
亞振家居	1,963	47,327.93
和科達	1,000	47,280.00
永吉股份	3,869	42,675.07
湘油泵	721	40,736.50
貝肯能源	1,042	40,221.20
元祖股份	2,241	39,665.70
皖天然氣	4,818	37,917.66
英飛特	1,359	35,157.33
浙江仙通	924	29,059.80
同為股份	1,126	24,220.26
常熟汽飾	2,316	24,179.04
天龍股份	1,562	22,852.06
天鐵股份	1,438	20,290.18
亞翔集成	2,193	15,592.23
華統股份	1,814	11,881.70
道恩股份	681	10,405.68
華正新材	1,874	10,063.38
德新交運	1,628	9,458.68
美聯新材	1,006	9,355.80
萬里馬	2,397	7,358.79
熙菱信息	1,104	5,453.76
長青集團	100	1,994.00

合計		1,075,634,661.64
(2)債券投資		
上市投資		
中國(100%)		
16 農發 01	500,000	50,000,000.00
12 豫交投 MTN4	100,000	10,212,000.00
合計		60,212,000.00
總投資資產		
1,135,846,661.64		
銀行存款和結算備付金		
94,332,450.71		
其他各項資產		
1,957,888.79		
合計		1,232,137,001.14

補充披露 2：投資組合變動表

序號	證券類別	占基金資產淨值的	占基金資產淨值的
		比例 (%)	比例 (%)
		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
1	股票	87.3	88.48
2	債券	4.89	0.69