华夏经典配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23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2018年1月1日起至6月30日止。

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

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏经典配置混合型证券投资基金
基金简称	华夏经典混合
基金主代码	288001
交易代码	288001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年3月15日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	761,529,191.46份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在长期投资的基础上,将战略资产配置与时机选择相结合,积极主动地精选证券,并充分利用短期金融工具作为动态配置的有效缓冲及收益补充,实施全流程的风险管理,力求在风险可控、获取稳定收益的基础上,追求资本最大可能的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动管理,遵循积极主动的投资理念,对股票和债券、短期金融工具的比例进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为60%×沪深300指数+20%×中证标合债券指数+20%×一年期定期存款利率。
风险收益特征	本基金是混合基金,风险与收益高于债券基金与货币市场基金,低于股票基金。本基金追求资产配置动态平衡,收益和长期资本增值平衡,风险适中。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	张燕
	联系电话	400-818-6666	0755-83199084
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区A区	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		杨明辉	李建红

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	-22,071,084.65
本期利润	-55,626.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0001
本期加权平均净值利润率	-0.01%
本期基金份额净值增长率	-0.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-2,326,706.01
期末可供分配基金份额利润	-0.0031
期末基金资产净值	759,202,485.45
期末基金份额净值	0.997
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	348.65%

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	-5.50%	1.48%	-4.49%	0.77%	-1.01%	0.71%
过去三个月	-3.48%	1.18%	-5.56%	0.68%	2.08%	0.50%
过去六个月	-0.20%	1.11%	-6.90%	0.69%	6.70%	0.42%
过去一年	-3.11%	0.98%	-1.20%	0.57%	-1.91%	0.41%
过去三年	-38.42%	1.18%	-8.64%	0.88%	-29.78%	0.30%
自基金合同生效起至今	348.65%	1.23%	151.12%	1.03%	197.53%	0.20%

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

华夏经典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
(2004年3月15日至2018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,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2018年6月30日数据),华夏经济转型股票在"股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金(A类)"中排序3/154;华夏医疗健康混合(A类)在"混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金(A类)"中排序2/152;华夏医药ETF、华夏消费ETF、华夏沪港通恒生ETF在"股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金"中分别排序2/115、8/115、9/115。

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《中国证券报》评奖活动中,公司荣获"中国基金业20周年卓越贡献公司"和"被动投资金牛基金公司"两大奖项,旗下华夏回报混合荣获"2017年度开放式混合型金牛基金"称号,华夏安康债券荣获"2017年度开放式债券型金牛基金"称号。在《证券时报》评奖活动中,旗下华夏永福混合和华夏回报混合荣获"三年持续回报极权益明星基金"称号,华夏安康债券荣获"三年持续回报极债券型明星基金"称号,华夏消费升级混合荣获"2017年度平衡混合型明星基金"称号。在《上海证券报》举行的2018中国基金业峰会暨第十五届"金基金"颁奖评选中,华夏基金荣获公募基金20周年"金基金"TOP基金公司大奖、华夏沪深300ETF获得第十五届"金基金"指数基金奖(一年期)、华夏上证50ETF获得第十五届"金基金"指数基金奖(三年期)。在《证券时报》的评奖活动中,华夏永福混合和华夏回报混合荣获"三年持续回报绝对收益明星基金"称号,华夏安康债券荣获"三年持续回报极债券型明星基金"称号,华夏消费升级混合荣获"2017年度平衡混合型明星基金"称号。

在客户服务方面,2018年上半年,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)华夏基金电子交易平台开展华夏财富宝货币A、华夏薪金宝货币转换业务优惠活动,为客户提供了更便捷和优惠的基金投资方式;(2)微信服务号上线随存随取业务实时通知功能,方便客户及时了解交易变动的情况;华夏基金网上交易平台上线手机号码登录功能,为客户登录网上交易平台提供了更便捷的方式;(3)与中原银行、长城华西银行、西安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"四大明星基金有奖寻人"、"华夏基金20周年司庆感恩二十年"、"华夏基金20周年献礼,华夏基金户口本"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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
佟巍	本基金的基金经理、股票投资部总监	2018-01-17	-	10年	美国密歇根大学工业工程、金融工程硕士。曾任雷曼兄弟亚洲投资有限公司,野村国际(香港)有限公司经构化信贷交易部交易员等。2009年1月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、投资经理,华夏大盘精选证券投资基金基金经理(2015年2月27日至2017年5月2日期间)、华夏新锦安灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年9月14日至2017年8月17日期间)、华夏新锦灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年9月14日至2017年8月17日期间)等。
许利明	本基金的基金经理、资产配置部总监	2016-03-25	2018-01-17	20年	北京工商大学产业经济学硕士。曾任北京国际信托投资公司投资银行总部项目经理,鹏翔证券有限责任公司资产管理总部总经理助理等,北京鹿苑天闻投资顾问有限责任公司首席投资顾问,天弘基金管理有限公司投资部副总经理,天弘精选混合型证券投资基金基金经理(2007年7月27日至2009年3月30日期间)等,中国国际金融有限公司投资经理、2011年6月加入华夏基金管理有限公司,曾任机构投资部投资经理,华夏军工安灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年3月22日至2017年3月28日期间)、华夏成长证券投资基金基金经理(2015年9月1日至2017年3月28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遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,国内经济增长方面,生产保持稳定,工业增加值表现出了较强的韧性,与PMI和发电量、商品价格等高频数据指向一致。固定资产投资持续下滑。分项看,地产投资比较平稳,主要是基建的快速下滑,1-6月基建同比增速降至7.3%,老口径降至3.3%,下滑明显。消费数据疲软,超出市场预期。今年以来社零增速连续下台阶,1-6月社会消费品零售总额同比增速为9.4%,其中5月下降至8.5%,已经稳定运行在之前几年10%的台阶之下,一定程度反应了居民收入和经济增长预期的压力。金融去杠杆影响开始显现,社融数据低于预期比较明显,上半年表外融资数量持续收缩,显示出监管层对于去杠杆的态度明确。

金融市场方面,在贸易战升级等外部压力和融资数据超预期下行的内部压力下,A股在6月加速下行,创出两年新低。

组合管理方面,基于对大宗商品熊市和经济增速回落的判断,本基金在年初回避了主要的顺周期行业,将资金主要配置在与经济相关度较小同时在行业中竞争地位具有明显优势的消费类公司。同时,组合也主动配置了一些具备高成长潜力的信息和技术类公司。随着部分股票估值的提升,风险收益比下降,组合在兑现部分股票收益的同时也尝试买入了一些估值合理并且行业供给格局较好的周期类股票。本基金坚持长期持有成长性较好且估值合理的优秀公司,以分享其带来的长期股权回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,本基金份额净值为0.997元,本报告期份额净值增长率为-0.20%,同期业绩比较基准增长率为-6.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国内经济基本面仍面临较大的不确定性。首先是去杠杆对经济增速的影响会进一步显现。从5月和6月的融资数据看,监管部门对于银行表外去杠杆的决心坚定,社融增速回到10%以内,对名义GDP产生明显的压制作用,因此经济基本面的下行的趋势还将延续,大多数与周期性关联较高的行业和公司的业绩仍然会有压力。需求端分结构看,中美贸易摩擦对出口影响的确定性增加,对经济的影响将逐渐体现出来。尽管净出口对于经济增长的贡献已经很小,但过去二十年中国经济增速和出口增速是高度相关的,主要原因就是出口企业获得的经济收益是启动国内相关投资和消费需求总的原动力。如果中美贸易摩擦对出口的损伤很大,将会影响到国内经济增速的中长期的中枢。

金融市场方面,相比于年初,A股的风险已经大幅度释放,部分股票的估值已经开始变得合理,尽管一些优质的公司估值仍然较贵。但是在基本面向下的宏观背景下,尤其是部分上市企业经营资金链风险或者股票质押风险得到释放之前,我们可以对市场更为耐心些。

在投资策略上,本基金将持续寻找长期能够创造价值的优秀公司,通过长期持有为持有人创造回报。同时,随着下半年去杠杆的进一步展开,经济增速下行压力进一步增加,股票市场的风险也会进一步释放,本基金也会择机买入价格出现严重低估的股票。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司"为信任奉献回报"的经营理念,规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价,制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度,建立了估值委员会,使用可靠的估值业务系统,设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术,并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华夏经典配置混合型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		-	-
银行存款		137,039,859.49	59,221,902.85
结算备付金		278,381.35	3,073,089.85
存出保证金		447,126.37	533,483.70
交易性金融资产		629,664,811.84	738,928,536.13
其中:股票投资		479,272,877.26	549,992,941.93
基金投资		-	-
债券投资		150,391,934.58	188,935,594.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	9,702,847.36
应收利息		1,012,806.14	3,614,758.80
应收股利		-	-
应收申购款		187,891.93	100,346.39
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		768,630,877.12	815,174,965.08

负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,108,766.52	1,005,110.03
应付赎回款		329,306.18	526,292.95
应付管理人报酬		970,048.14	1,027,194.69
应付托管费		161,674.65	171,199.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,407,986.46	3,225,666.54
应交税费		2,046,270.92	2,045,657.12
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		404,338.80	320,760.72
负债合计		9,428,391.67	8,321,881.14
所有者权益:		-	-
实收基金		761,529,191.46	807,892,388.39
未分配利润		-2,326,706.01	-1,039,304.45
所有者权益合计		759,202,485.45	806,853,083.94
负债和所有者权益总计		768,630,877.12	815,174,965.08

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.997元,基金份额总额761,529,191.46份。

6.2 利润表

会计主体:华夏经典配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		9,157,084.18	60,018,614.26
1.利息收入		2,894,808.37	6,279,931.03
其中:存款利息收入		275,412.73	320,722.62
债券利息收入		2,616,772.00	5,943,535.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,623.64	15,673.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-15,774,013.43	-12,044,633.55
其中:股票投资收益		-19,591,849.01	-15,371,934.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,535,895.12	-1,949,859.65
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,353,730.70	5,277,160.66
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		22,015,458.10	65,758,677.45
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		20,831.14	24,639.33
减:二、费用		9,212,710.73	11,848,935.50
1.管理人报酬		5,897,251.46	7,026,424.42
2.托管费		982,875.28	1,171,070.76
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		2,122,433.78	3,408,568.11
5.利息支出		34,520.55	65,834.23
其中:卖出回购金融资产支出		34,520.55	65,834.23
6.税金及附加		182.41	-
7.其他费用		175,447.25	177,037.98
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-55,626.55	48,169,678.76
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-55,626.55	48,169,678.76

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华夏经典配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	807,892,388.39	-1,039,304.45	806,853,083.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-55,626.55	-55,626.55
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)	-46,363,196.93	-1,231,775.01	-47,594,971.94
其中:1.基金申购款	29,602,137.59	1,321,638.86	30,923,776.45
2.基金赎回款	-75,965,334.52	-2,553,413.87	-78,518,748.39
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)	761,529,191.46	-2,326,706.01	759,202,485.45

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	979,455,143.56	-21,855,686.15	957,599,457.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,169,678.76	48,169,678.76
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)	-67,957,568.50	-202,343.43	-68,159,911.93
其中:1.基金申购款	13,535,757.69	-65,166.92	13,470,590.77
2.基金赎回款	-81,493,326.19	-137,176.51	-81,630,502.70
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)	911,497,575.06	26,111,649.18	937,609,224.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:杨明辉,主管会计工作负责人:汪贵华,会计机构负责人:汪贵华

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	1,368,332,539.68	100.00%	2,170,684,903.57	94.86%

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	150,218,852.34	100.00%	20,969,729.70	100.00%

6.4.4.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	20,000,000.00	100.00%	199,000,000.00	100.00%

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	1,274,325.00	100.00%	851,847.51	60.51%

关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	2,021,555.87	94.86%	1,010,918.14	45.05%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,897,251.46	7,026,424.42
其中:支付销售机构的客户维护费	811,444.43	976,319.07

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	982,875.28	1,171,070.76

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	137,039,859.49	260,991.45	6,115,258.44	296,645.65

注:本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.5.1.1 受限证券类别:股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新发流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.6.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定,以公允价值计量的金融工具,其公允价值的计量可分为三个层次:

第一层次:对存在活跃市场报价的金融工具,可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次:对估值日活跃市场无报价的金融工具,可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值;对估值日不存在活跃市场的金融工具,可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次:对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具,可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至2018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578,564,811.84元,第二层次的余额为51,100,000.00元,第三层次的余额为0元。(截至2017年12月31日止:第一层次的余额为550,891,341.93元,第二层次的余额为188,037,194.20元,第三层次的余额为0元。)

6.4.6.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票,本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次,于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票,本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次,于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

6.4.6.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	479,272,877.26	62.35
	其中:股票	479,272,877.26	62.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	150,391,934.58	19.57
	其中:债券	150,391,934.58	19.57
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	137,318,240.84	17.87
8	其他各项资产	1,647,824.44	0.21
9	合计	768,630,877.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	285,825,023.96	37.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,456.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,717,129.32	4.97
J	金融业	110,995.50	0.01
K	房地产业	74,448,096.40	9.81
L	租赁和商务服务业	22,974,890.40	3.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	879,000.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	57,269,285.68	7.54
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	479,272,877.26	63.13

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	91,900	67,221,174.00	8.85
2	300015	爱尔眼科	1,773,592	57,269,285.68	7.54
3	603039	泛微网络	429,189	37,717,129.32	4.97
4	600048	保利地产	2,880,800	35,145,760.00	4.63
5	000858	五粮液	411,200	31,251,200.00	4.12
6	600809	山西汾酒	485,000	30,501,650.00	4.02
7	000002	万科A	1,180,579	29,042,243.40	3.83
8	000651	格力电器	495,000	23,339,250.00	3.07
9	002415	海康威视	618,995	22,983,284.35	3.03
10	002027	分众传媒	2,400,720	22,974,890.40	3.03

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的