

华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

Table with columns: 姓名, 职务, 任职本基金基金经理年限, 证券从业年限, 说明

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于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...

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。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有投资,投资者在作出投资决策前应当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。

2.1 基金基本情况

Table with columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金币种

2.2 基金产品说明

Table with columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with columns: 名称, 姓名, 联系电话, 电子邮箱, 传真, 注册地址, 办公地址, 邮政编码, 法定代表人

2.4 信息披露方式

Table with columns: 信息披露网站, 基金半年度报告备置地点

3 主要财务指标和基金净值表现

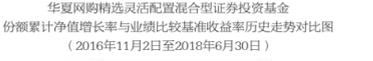
3.1 主要会计数据和财务指标

Table with columns: 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)

3.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 份额净值增长, 份额累计净值增长, 业绩比较基准, 业绩比较基准偏离

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2016年11月22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1988年4月9日,是经中国证监会批准设立的首批全国性基金管理公司之一...

4.1.2 基金经理
基金管理人、境内首任ETF基金管理人、境内首批沪港通ETF基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人...

4.1.3 基金管理人、香港子公司、首任全球资产配置公募基金经理、首任公募POF基金经理、首任全球资产配置公募基金经理、香港子公司首任ROF基金经理...

4.1.4 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

4.1.5 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
华夏基金以深入的投资研究为基础,尽一切手段捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。

4.1.6 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《中国证券报》“2017年度中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2017年度中国基金业金牛奖”称号...

4.1.7 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《证券时报》“2017年度中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2017年度中国基金业金牛奖”称号...

4.1.8 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《上海证券报》举办的“2018中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2018中国基金业金牛奖”称号...

4.1.9 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《证券时报》举办的“2018中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2018中国基金业金牛奖”称号...

4.1.10 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《中国证券报》举办的“2018中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2018中国基金业金牛奖”称号...

4.1.11 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《上海证券报》举办的“2018中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2018中国基金业金牛奖”称号...

4.1.12 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《证券时报》举办的“2018中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2018中国基金业金牛奖”称号...

4.1.13 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《中国证券报》举办的“2018中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2018中国基金业金牛奖”称号...

4.1.14 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《上海证券报》举办的“2018中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2018中国基金业金牛奖”称号...

4.1.15 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《证券时报》举办的“2018中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2018中国基金业金牛奖”称号...

4.1.16 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
在《中国证券报》举办的“2018中国基金业金牛奖”评选中,华夏基金荣获“2018中国基金业金牛奖”称号...

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、安全合规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组合,制定并严格执行相应的制度和流程,通过系统化工具等方式在各环节严格控制公平交易行为。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 管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
上半年,国际方面,美国经济持续增长,美联储两次加息,美元大幅升值,欧洲复苏态势有所放缓,欧元下跌。国内方面,基建与地产承压,美国贸易的贸易顺差也增加了出口的不确定性,虽然上半年GDP增长6.8%,但从社融数据也可看出,经济面临一定的下行压力,政府继续进行供给侧改革,并继续提供有效供给;同时为控制风险,着力推动去杠杆,但为确保在去杠杆的同时缓解小微企业融资难融资贵的问题,央行定向降准,进行结构性引导,整体而言,货币政策组合资源信用、稳货币态势、汇率方面,4月份开始美元升值明显,人民币汇率贬值幅度较大。

市场方面,年初在配置资金涌入、外围经济向好尤其股票市场不断走高等因素带动下,A股市场风险偏好明显提升,演绎了一波超短上涨;2月初由于美国经济数据超预期,引发市场对美联储超预期加息的担忧,美国股市深度调整,并带动全球股市快速深跌,A股市场随美国股市下跌并在短空反弹后又受贸易战、信用紧缩等因素拖累,重回调整。特别是息月以来,市场继续下挫,市场情绪效已历史低位;市场波动率显著提高,行业层面上,国防军工行业,具有较高业绩确定性和稳定现金流的行业如医药、家电、食品饮料等有明显超额收益。

基金投资运作方面,作为灵活配置型基金,我们依据模型在报告期内进行了量化模型择时,仓位保持在对稳健的水平。行业和股票选择上,我们结合宏观数据以及量化选择模型进行组合构建。

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0.919元,本报告期份额净值增长率为-1.104%,同期业绩比较基准增长率为-0.33%。

4.5 管理人对宏观经济的展望
本基金管理人认为,未来中国经济在稳增长、调结构的政策引导下,仍将保持韧性,但贸易摩擦、全球经济增长放缓等因素,仍将给中国经济带来一定下行压力,政府将继续进行供给侧改革,并继续提供有效供给;同时为控制风险,着力推动去杠杆,但为确保在去杠杆的同时缓解小微企业融资难融资贵的问题,央行定向降准,进行结构性引导,整体而言,货币政策组合资源信用、稳货币态势、汇率方面,4月份开始美元升值明显,人民币汇率贬值幅度较大。

市场方面,A股整体估值水平已接近历史低位,具有较高的安全边际,如果经济或政策超预期,市场情绪有望恢复,A股市场有望震荡上扬的走势。

投资策略上,我们会重点关注国际关系、国内经济运行情况及政策的变化,并密切跟踪贸易纠纷后续发展情况,在组合管理上保持一个稳健的组合仓位。

4.6 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
珍珍基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.7 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.8 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.9 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.10 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.11 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.12 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.13 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.14 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.15 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.16 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.17 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.18 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.19 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.20 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.21 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.22 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.23 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.24 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.25 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.26 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.27 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.28 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.29 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.30 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.31 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.32 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

单位:人民币元

Table with columns: 项目, 期初, 本期, 上期

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。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with columns: 项目, 2018年1月1日至2018年6月30日, 所有者权益合计

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。

4.4 管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
上半年,国际方面,美国经济持续增长,美联储两次加息,美元大幅升值,欧洲复苏态势有所放缓,欧元下跌。国内方面,基建与地产承压,美国贸易的贸易顺差也增加了出口的不确定性,虽然上半年GDP增长6.8%,但从社融数据也可看出,经济面临一定的下行压力,政府继续进行供给侧改革,并继续提供有效供给;同时为控制风险,着力推动去杠杆,但为确保在去杠杆的同时缓解小微企业融资难融资贵的问题,央行定向降准,进行结构性引导,整体而言,货币政策组合资源信用、稳货币态势、汇率方面,4月份开始美元升值明显,人民币汇率贬值幅度较大。

市场方面,年初在配置资金涌入、外围经济向好尤其股票市场不断走高等因素带动下,A股市场风险偏好明显提升,演绎了一波超短上涨;2月初由于美国经济数据超预期,引发市场对美联储超预期加息的担忧,美国股市深度调整,并带动全球股市快速深跌,A股市场随美国股市下跌并在短空反弹后又受贸易战、信用紧缩等因素拖累,重回调整。特别是息月以来,市场继续下挫,市场情绪效已历史低位;市场波动率显著提高,行业层面上,国防军工行业,具有较高业绩确定性和稳定现金流的行业如医药、家电、食品饮料等有明显超额收益。

基金投资运作方面,作为灵活配置型基金,我们依据模型在报告期内进行了量化模型择时,仓位保持在对稳健的水平。行业和股票选择上,我们结合宏观数据以及量化选择模型进行组合构建。

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0.919元,本报告期份额净值增长率为-1.104%,同期业绩比较基准增长率为-0.33%。

4.5 管理人对宏观经济的展望
本基金管理人认为,未来中国经济在稳增长、调结构的政策引导下,仍将保持韧性,但贸易摩擦、全球经济增长放缓等因素,仍将给中国经济带来一定下行压力,政府将继续进行供给侧改革,并继续提供有效供给;同时为控制风险,着力推动去杠杆,但为确保在去杠杆的同时缓解小微企业融资难融资贵的问题,央行定向降准,进行结构性引导,整体而言,货币政策组合资源信用、稳货币态势、汇率方面,4月份开始美元升值明显,人民币汇率贬值幅度较大。

市场方面,A股整体估值水平已接近历史低位,具有较高的安全边际,如果经济或政策超预期,市场情绪有望恢复,A股市场有望震荡上扬的走势。

投资策略上,我们会重点关注国际关系、国内经济运行情况及政策的变化,并密切跟踪贸易纠纷后续发展情况,在组合管理上保持一个稳健的组合仓位。

4.6 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
珍珍基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.7 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.8 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.9 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.10 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.11 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.12 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.13 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.14 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.15 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.16 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.17 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.18 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.19 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.20 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.21 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.22 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.23 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.24 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.25 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.26 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.27 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.28 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.29 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

4.30 基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理
报告期内,本基金管理人、香港子公司首任ROF基金经理,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。

2018年半年度报告摘要

7.1 期末基金资产组合情况

Table with columns: 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(%)

注:上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本报告披露截止日。
6.4.5.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
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/负债可比市场交易的金融工具,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三层次的余额为46,698,637.65元,第二层次的余额为62,251,000元,第一层次的余额为1,042,000.00元(截至2017年12月31日止,第一层次的余额为37,688,567.85元,第二层次的余额为10,247,070.00元,第三层次的余额为0元)。
6.4.6.3 公允价值所属层级的重大变动
对于特殊事项停牌期间的股票,本基金关于股票公允价值所属层次于其在估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次,于股票复牌体现公允价值并恢复市价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,于限售期满并限售市价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。

7.2 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

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

7.2 投资组合报告
7.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

7.2.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.3 报告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
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产
金额单位:人民币元

7.3 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

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

7.2 投资组合报告
7.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

7.2.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.3 报告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
金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

7.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资
金额单位:人民币元