

华夏成长证券投资基金

2018年第三季度报告

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。

§6投资情况报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
张明	基金经理	2010-01-07	-	美国加州大学伯克利分校金融学硕士,工商管理硕士,曾任中国建设银行总行公司业务管理部副经理,2009年加入华夏基金管理有限公司,曾任华夏基金成长证券投资基金基金经理助理,华夏基金核心成长证券投资基金基金经理(2017年9月19日至2018年9月30日)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 管理人对于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、研究活动的内控与内幕交易管理办法》、基金合同和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的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 公平交易专项说明

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。

4.3.3 异常交易专项说明

报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内方面,受美联储加息和宏观经济下行影响,整体市场承压,但在财政货币政策出台后,风险充分消化,典型特征为上证50录得反弹,中小盘则在10%以上。受益于去杠杆转向,金融、制造业、消费品等行业均有放松政策措施出台,信贷宽松已有效缓解,经济企稳的可能性较大。利率层面,总仓流动性较为宽松,但利率在低位,向实体经济传导不畅。国外经济整体平稳,贸易战目前暂未明显影响贸易增长,美国仍处于一枝独秀状态。

3季度,受美联储加息和宏观经济下行影响,整体市场承压,但在财政货币政策出台后,风险充分消化,典型特征为上证50录得反弹,中小盘则在10%以上。受益于去杠杆转向,金融、制造业、消费品等行业均有放松政策措施出台,信贷宽松已有效缓解,经济企稳的可能性较大。利率层面,总仓流动性较为宽松,但利率在低位,向实体经济传导不畅。国外经济整体平稳,贸易战目前暂未明显影响贸易增长,美国仍处于一枝独秀状态。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至2018年9月30日,本基金份额净值为0.984元,本报告期份额净值增长率为-5.94%,同期上证综指下跌9.2%,深证成指下跌10.43%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

4.1 基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,749,300,714.57	63.57
2	固定收益投资	966,031,767.68	22.81
3	其中:债券	966,031,767.68	22.81
4	货币资金	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,017,039,196.29	24.43
7	其他流动资产	72,892,071.76	1.73
8	合计	4,304,262,794.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	医药生物	-	-
C	制造业	1,114,652,294.62	26.07
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	68,701.29	0.00
E	信息技术	8,669,311.71	0.20
F	批发和零售业	114,034,524.46	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	16,038,713.68	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	671,363,093.25	15.54
J	房地产业	263,196,714.87	6.13
K	公用事业	219,023,722.63	5.13
L	科学研究和技术服务业	10,669,389.23	0.25
M	水利、环境和公共设施管理业	10,768,484.33	0.26
N	国防军工	-	-
O	其他	-	-
P	合计	2,749,300,714.57	64.30

5.3 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明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002316	三星医疗	60,168,808	268,726,804.00	6.06
2	002217	润兴股份	20,189,907	213,516,396.24	4.89
3	300089	吉视传媒	19,940,203	204,367,089.76	4.70
4	000069	华侨城A	200,132,807.99	200,132,807.99	4.60
5	300226	上海钢联	3,104,079	184,064,163.33	4.23
6	000049	华明装备	2,727,419	128,576,649.38	2.91
7	002236	大华股份	8,063,212	127,166,611.24	2.89
8	001310	中原特钢	1,600,000	105,360,000.00	2.40
9	000020	中国石化	1,403,911	96,126,753.46	2.23
10	000039	浦发银行	122,662	89,722,000.00	2.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债券	-	-
5	其他固定收益品种	-	-
6	合计	-	-

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	13国债01	13国债01	1,100,000	13,000,000.00	0.30
2	13国债02	13国债02	1,100,000	13,000,000.00	0.30
3	13国债03	13国债03	1,100,000	13,000,000.00	0.30
4	13国债04	13国债04	1,100,000	13,000,000.00	0.30
5	13国债05	13国债05	1,100,000	13,000,000.00	0.30

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	-	-	-
2	白银	-	-	-
3	铂金	-	-	-
4	钌	-	-	-
5	铑	-	-	-

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资

序号	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1809	-	-	-
2	IF1810	-	-	-
3	IF1811	-	-	-
4	IF1812	-	-	-
5	IF1901	-	-	-

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

序号	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	-	-	-	-
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.10 报告期末本基金投资的国债期货情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 国债期货投资情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,924.77
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	68,106,028.57
4	应收股利	-
5	应收申购款	14,567,710.07
6	其他应收款	2,561,638.84
7	待摊费用	-
8	其他流动资产	1,263,481.88
9	合计	72,902,073.36

6.1.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债07	1,000,000.00	0.24
3	121038	12国债08	1,000,000.00	0.24
4	121039	12国债09	1,000,000.00	0.24
5	121040	12国债10	1,000,000.00	0.24

6.1.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121036	12国债06	1,000,000.00	0.24
2	121037	12国债0		