华夏优势增长混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏优势增长混合
基金主代码	000021
交易代码	000021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月24日
报告期末基金份额总额	3,771,417,350.73份
投资目标	追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金主要采取"自下而上"的个股精选策略,以GARP模型为基础,结合严谨、深入的基本面分析和全面、细致的估值分析和市场面分析,精选出具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估、价格处于合理区间的股票进行投资。同时,考虑到我国股票市场的波动性,基金将主动进行资产配置,即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析,调整基金在股票、债券等资产类别上的投资比例,以降低投资风险,提高累积收益。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标,同时根据需要进行积极操作,以提高基金收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为富时中国A600指数,债券投资的业绩比较基准为中债综合指数(财富)。基准收益率=富时中国A600指数收益率×80%+中债综合指数(财富)收益率×20%。
风险收益特征	本基金风险高于货币市场基金、债券基金,属于较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	248,006,992.67
2.本期利润	289,005,053.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0700
4.期末基金资产净值	6,771,174,576.36
5.期末基金份额净值	1.795

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。

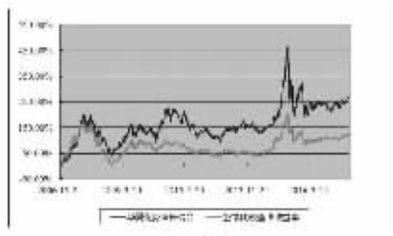
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	4.12%	0.80%	3.88%	0.49%	0.24%	0.31%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

华夏优势增长混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年11月24日至2017年9月30日)



§4管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓晓辉	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2013-05-10	-	14年	北京大学金融学博士。曾任长盛基金研究员、基金经理助理、同德证券投资基金基金经理(2006年11月29日至2008年4月26日期间)等。2008年5月加入华夏基金管理有限公司,曾任投资经理、机构投资部总经理助理、机构投资部副总经理、股票投资部副总经理,华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年6月16日至2016年9月14日期间)等。
孙轶佳	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2015-11-19	-	9年	上海交通大学金融学硕士。曾任中银国际金融有限公司研究部高级经理等。2011年8月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理等。
刘平	本基金的基金经理、股票投资部总监	2015-11-30	-	10年	金融学硕士。2007年2月加入华夏基金管理有限公司,曾任行业研究员、投资经理,机构投资部总监等。

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 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 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

3季度,国际方面,美国经济仍然处于复苏通道,但通胀低于预期,加息预期因此降低,美元指数大幅下跌;欧洲、日本经济数据继续改善,欧央行不断传递货币政策将逐步正常化的预期,欧元大涨。国内方面,经济仍延续复苏趋势,企业盈利继续改善,但由于天气原因以及供给侧改革等因素影响下,7、8月经济有所回落。受去产能及环保政策影响,国内大宗商品价格出现明显上涨,PPI上涨超预期;央行继续维持了偏紧的流动性环境,M2增长创新低。在美元走弱背景下,人民币持续升值。

3季度,A股市场整体呈现震荡上升格局,受益于大宗商品价格大幅上涨的有色、钢铁、采掘等行业表现相对较好,估值相对较高而增长低于预期的传媒、纺织等行业,以及受损于原材料价格上涨的家电、公用事业等行业表现相对较差。报告期内,本基金保持了较高仓位,进一步优化了基金的组合结构。主要是减持了一些业绩增长低于预期、估值偏贵、涨幅偏大的个股,增持了一些业绩增长较为确定、估值相对较为合理的优质个股,少量布局了一些未来长期增长空间较大、业绩即将进入爆发期的个股。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.795元,本报告期份额净值增长率为4.12%,同期业绩比较基准增长率为3.88%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,250,539,917.34	90.93
	其中:股票	6,250,539,917.34	90.93
2	固定收益投资	100,305,336.02	1.46
	其中:债券	100,305,336.02	1.46
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	159,962,299.93	2.33
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	358,791,507.87	5.22
7	其他各项资产	4,703,029.92	0.07
8	合计	6,874,292,091.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	33,977,054.52	0.50
B	采矿业	166,015,242.54	2.45
C	制造业	4,452,836,559.23	65.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	70,665,594.96	1.04
E	建筑业	22,612,808.40	0.33
F	批发和零售业	202,625,147.04	2.99
G	交通运输、仓储和邮政业	73,855,583.41	1.09
H	住宿和餐饮业	5,879,404.80	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	296,080,194.09	4.36
J	金融业	755,998,167.77	11.16
K	房地产业	89,269,976.00	1.32
L	租赁和商务服务业	10,050,000.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	31,357,444.32	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,959,857.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	27,356,883.26	0.40
S	综合	-	-
	合计	6,250,539,917.34	92.31

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	600703	三安光电	15,974,500	369,649,930.00	5.46
2	002456	欧菲光	12,275,276	260,113,077.25	3.84
3	300145	中金环境	14,420,844	244,000,680.48	3.60
4	002635	安洁科技	4,322,878	175,768,219.48	2.60
5	300156	神雾环保	6,598,842	165,300,992.10	2.44
6	002460	赣锋锂业	1,630,800	142,368,840.00	2.10
7	600563	法拉电子	2,397,456	138,572,956.80	2.05
8	000968	蓝焰控股	6,998,959	117,092,584.07	1.73
9	603799	华友钴业	1,250,600	114,392,382.00	1.69
10	000858	五粮液	1,993,074	114,163,278.72	1.69

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,670,000.00	1.47
	其中:政策性金融债	99,670,000.00	1.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	635,336.02	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,305,336.02	1.48

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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170410	17农发10	1,000,000	99,670,000.00	1.47
2	123001	蓝标转债	6,029	635,336.02	0.01
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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的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出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	1,176,454.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	798,072.34
5	应收申购款	2,728,503.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,703,029.92

5.11.4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	123001	蓝标转债	635,336.02	0.01

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300145	中金环境	244,000,680.48	3.60	重大事项
2	300156	神雾环保	165,300,992.10	2.44	重大事项

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,907,221,490.96
报告期基金总申购份额	78,581,461.96
减:报告期基金总赎回份额	214,385,602.19
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,771,417,350.73

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1,报告期内披露的主要事项

2017年7月20日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增南京苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告。

2017年8月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民生证券股份有限公司为代销机构的公告。

2017年9月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增通华财富(上海)基金销售有限公司为代销机构的公告。

2017年9月29日发布华夏基金管理有限公司公告。

2,其他相关信息

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,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2017年9月29日数据),华夏消费升级混合A在255只灵活配置型基金(股票上下限0-95%+基准股票比例30%-60%)(A类)中排名第8;华夏回报混合A和华夏回报二号混合分别在171只绝对收益目标基金(A类)中排名第3和第5;华夏可转债增强债券A在17只可转换债券型基金(A类)中排名第5;华夏理财30天债券A在39只短期理财债券型基金(A类)中排名第8;华夏全球股票(QDII)在56只QDII股票型基金(A类)中排名第3;华夏收益债券(QDII)A及华夏大中华信用债券(QDII)A分别在15只QDII债券型基金(A类)中排名第1和第4。

在客户服务方面,3季度,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)升级华夏基金官网、与支付宝合作上线华夏基金财富号,为客户提供更便捷的基金投资和理财交流平台;(2)升级华夏基金官网、微官网、APP、微信、财富社区等多个渠道的在线客服系统,有效提升客户的服务满意度;(3)与星展银行、民生证券等代销机构合作,提供更多理财渠道,进一步提升客户体验;(4)开展"一门两世界,温差20度"、"华夏回报累计分红78次"、"火热报北马,一触'基'发"等多项活动,为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件;

9.1.2《华夏优势增长混合型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏优势增长混合型证券投资基金托管协议》;

9.1.4法律意见书;

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一七年十月二十五日

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏蓝筹混合(LOF)
场内简称	华夏蓝筹
基金主代码	160311
交易代码	160311
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2007年4月24日
报告期末基金份额总额	2,998,329,367.04份
投资目标	追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基准收益率=沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金是混合基金,风险高于货币市场基金和债券基金,低于股票基金,属于较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	173,870,590.34
2.本期利润	132,734,743.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0431
4.期末基金资产净值	4,471,830,182.35
5.期末基金份额净值	1.491

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。

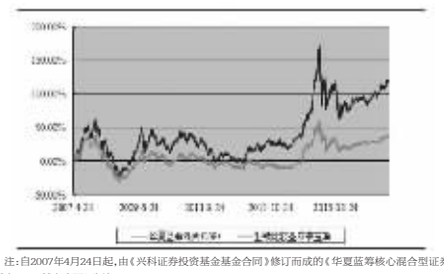
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	2.97%	0.67%	2.85%	0.36%	0.12%	0.31%

3.2.2 自基金转型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

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2007年4月24日至2017年9月30日)



注:自2007年4月24日起,由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。

§4管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王怡欢	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2011-02-22	-	13年	北京大学经济学硕士。2004年6月加入华夏基金管理有限公司,曾任行业研究员、行业研究主管、基金经理助理等。

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 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 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

3季度,国内宏观经济表现较好。由于欧洲和美国的复苏力度超过预期,外需对中国出口的拉动作用较强;房地产销售和投资数据也好于之前普遍的悲观预期,尤其是三四线城市成交火爆,价格继续上涨,房地产投资数据也基本平稳;政府基建投资和企业固定资产投资都保持平稳,市场开始热烈讨论中国经济是否进入"新周期";消费整体保持平稳,亮点在于部分行业持续的消费升级。市场方面,3季度股市成为今年前三个季度中表现最好的一个季度,各个行业和板块轮流反弹,尤其是部分上游资源性行业做多机会明显。

报告期内,本基金股票仓位变化不大,适度增持了受益于全球经济企稳、需求复苏而供给增长缺乏弹性的部分工业金属个股,以及受益于国内产业政策的其他周期品,减持了部分估值到位的消费品个股。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.491元,本报告期份额净值增长率为2.97%,同期业绩比较基准增长率为2.85%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,797,386,657.78	84.36
	其中:股票	3,797,386,657.78	84.36
2	固定收益投资	247,345,303.30	5.49
	其中:债券	247,345,303.30	5.49
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	92,900,579.35	2.06
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	360,224,483.61	8.00
7	其他各项资产	3,564,022.42	0.08
8	合计	4,501,421,046.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	4,971,580.20	0.11
B	采矿业	243,049,543.72	5.44
C	制造业	1,951,638,527.63	43.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	284,813,418.28	6.37
E	建筑业	30,217,218.00	0.68
F	批发和零售业	108,006,757.43	2.42
G	交通运输、仓储和邮政业	307,358,995.15	6.87
H	住宿和餐饮业	31,397,079.80	0.70
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,205,550.03	1.01
J	金融业	741,694,620.70	16.59
K	房地产业	25,239,266.34	0.56
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,464,500.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	7,329,600.50	0.16
S	综合	-	-
	合计	3,797,386,657.78	84.92

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	600036	招商银行	15,849,954	404,966,324.70	9.06
2	600116	三峡水利	21,459,739	211,163,831.76	4.72
3	600029	南方航空	23,699,965	195,998,627.85	4.38
4	600690	青岛海尔	9,464,281	142,816,000.29	3.19
5	601318	中国平安	2,528,950	136,967,932.00	3.06
6	601398	工商银行	19,399,994	116,399,964.00	2.60
7	000968	蓝焰控股	5,069,500	84,812,735.00	1.90
8	601233	桐昆股份	4,499,971	77,219,502.36	1.73
9	600004	白云机场	5,707,471	74,710,795.39	1.67
10	601988	中国银行	18,000,000	74,160,000.00	1.66

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	国家债券	228,252,000.00	5.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,093,303.30	0.43
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	247,345,303.30	5.53

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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	020191	17贴债35	2,300,000	228,252,000.00	5.10
2	112044	11中泰01	50,000	5,130,500.00	0.11
3	122911	10银城投	34,860	3,519,814.20	0.08
4	122080	11康美债	25,110	2,530,585.80	0.06
5	122641	PR武城投	80,000	2,014,400.00	0.05

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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的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出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	790,217.39
2	应收证券清算款	172,250.91
3	应收股利	-
4	应收利息	2,013,706.48
5	应收申购款	587,847.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,564,022.42

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,101,589,361.60
报告期基金总申购份额	78,826,118.96
减:报告期基金总赎回份额	182,086,113.52
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,998,329,367.04

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	57,727,975.27
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	57,727,975.27
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.93

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1,报告期内披露的主要事项

2017年7月20日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增南京苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告。

2017年8月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民生证券股份有限公司为代销机构的公告。

2017年9月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增通华财富(上海)基金销售有限公司为代销机构的公告。

2017年9月29日发布华夏基金管理有限公司公告。

2,其他相关信息

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,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2017年9月29日数据),华夏消费升级混合A在255只灵活配置型基金(股票上下限0-95%+基准股票比例30%-60%)(A类)中排名第8;华夏回报混合A和华夏回报二号混合分别在171只绝对收益目标基金(A类)中排名第3和第5;华夏可转债增强债券A在17只可转换债券型基金(A类)中排名第5;华夏理财30天债券A在39只短期理财债券型基金(A类)中排名第8;华夏全球股票(QDII)在56只QDII股票型基金(A类)中排名第3;华夏收益债券(QDII)A及华夏大中华信用债券(QDII)A分别在15只QDII债券型基金(A类)中