华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF) 2017年年度报告摘要

2017年12月31日

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:二〇一八年三月二十八日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月26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。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
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
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
报告期末基金份额总额	2,822,366,368.47份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年5月28日

2.2 基金产品说明

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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	陆志俊
	联系电话	400-818-6666	95559
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-818-6666	95559
传真		010-63136700	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	453,156,717.92	-288,475,635.15	3,610,801,337.30
本期利润	1,029,600,794.61	-641,821,662.65	2,556,572,654.76
加权平均基金份额本期利润	0.3334	-0.1882	0.5351
本期加权平均净值利润率	23.53%	-14.97%	38.95%
本期基金份额净值增长率	26.53%	-13.03%	30.23%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	3,270,784,429.43	2,701,937,210.19	3,514,746,668.37
期末可供分配基金份额利润	1.1589	0.8262	1.0142
期末基金资产净值	4,480,724,091.32	4,103,987,273.40	5,000,388,572.96
期末基金份额净值	1.588	1.255	1.443
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	134.25%	85.13%	112.87%

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
过去三个月	6.51%	0.82%	3.10%	0.48%	3.41%	0.34%
过去六个月	9.67%	0.74%	6.04%	0.42%	3.63%	0.32%
过去一年	26.53%	0.71%	12.98%	0.38%	13.55%	0.33%
过去三年	43.32%	1.51%	15.49%	1.01%	27.83%	0.50%
过去五年	114.88%	1.34%	46.85%	0.93%	68.03%	0.41%
自基金转型以来至今	134.25%	1.42%	41.79%	1.09%	92.46%	0.33%

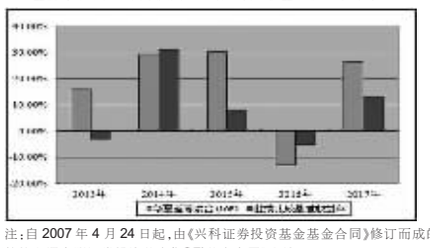
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2007年4月24日至2017年12月31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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§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2017年12月31日数据),华夏大盘精选混合在135只混合偏股型基金中排名第7,华夏消费升级混合A在263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10;华夏回报混合A和华夏回报二号混合分别在174只绝对收益目标基金(A类)中排名第3和第4;华夏安康债券A在177只普通债券型基金(二级A类)中排名第7;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4;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3。

在《中国证券报》主办的第十四届中国基金业金牛奖的评选中,华夏基金获得"2016年度被动投资金牛基金公司"奖。在《中国基金报》主办的"中国基金业20年最佳产品创新评选"中,华夏基金荣获"十大产品创新基金公司奖",并收获五大产品奖项,是获奖最多的基金公司。

在客户服务方面,2017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)升级华夏基金官网、微官网、APP、微信、财富社区等多个端口的在线客服系统,进一步提升了客户的服务体验;(2)上线基金管家APP固定业务自助办理功能,为客户提供了更便捷的业务办理方式;(3)与花旗银行、星展银行、民生证券、国美基金、嘉实财富等基金销售机构合作,为客户提供了更多的理财渠道;(4)开展"知识就是红包"、"华夏基金19周年司庆"、"FOF基金知识大挑战"、"货家三兄弟迎新年"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
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。
董阳阳	本基金的基金经理、股票投资部总监	2013-03-11	2017-02-24	9年	英国波士顿学院金融学硕士、工商管理学硕士,曾任中国国际金融有限公司投行业务部经理。2009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、投资经理等。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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,本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(1日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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

2017年,国际经济稳步复苏,且复苏态势由美国向欧洲、日本扩散;另一方面,国内经过实体经济供给侧改革和金融去杠杆,有力夯实了经济底部,并在相当程度上化解了金融风险,为宏观经济后续持续健康增长创造了良好基础。稳定向好的经济环境叠加平稳的流动性环境,A股市场全年表现可圈可点,上证综指上涨6.56%,尤其是受益于稳定的下游需求和持续集中的行业格局的消费品龙头涨幅最为耀眼。

报告期内,基于对经济见底回升和A股优秀上市公司价值重估的信心,本基金保持了较高的股票仓位,重点投资于低估值金融周期股和消费行业龙头个股,取得了较好的投资效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日,本基金份额净值为1.588元,本报告期份额净值增长率为26.53%,同期业绩比较基准增长率为12.98%。

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2018年,我们认为国内经济增长虽然面临着诸如地产产业链回落、基建投资高增长不可持续等压力,但仍有望保持相对较高的速度,且增长质量稳步改善。A股主要板块优质公司的业绩改善也仍在路上,A股在全球资产配置中的重要性将持续提升。我们仍将保持积极的心态,重点在金融、消费品、优秀制造业等领域精选个股,分享市场成长。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面,公司认真落实投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查管理、合规管理办法等基金行业新规,紧密跟踪监管要求,促进公司业务合法合规;公司不断完善内部制度建设,制定了投资者适当性管理制度、合规考核制度、微博微信使用合规管理制度等多项制度,修订了反洗钱相关制度,编制了合规管理制度汇编;公司结合新颁布的法律法规,以投资研究和销售业务条线为重点,开展了多种形式的合规培训,不断提升员工的合规守法意识;强化事前事中合规风险管理,对信息披露文件严格把关,认真审核基金宣传推介材料,加强了对公司和员工使用微博、微信等新媒体进行宣传的合规管理,防范各类合规风险。在风险管理方面,公司秉承全员风险管理的理念,采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,加强对日常投资运作的管理和监控,督促投研交易业务的合规开展;在监察稽核方面,公司定期和不定期开展多项内部稽核,对投资研究、基金交易、市场销售、后台运作等关键业务和岗位进行检查监督,促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心,坚持基金份额持有人利益优先的原则,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

2017年度,基金托管人在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017年度,华夏基金管理有限公司在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017年度,由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第21143号

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人:

6.1 审计意见

(1)我们审计的内容

我们审计了华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"华夏蓝筹混合(LOF)基金")的财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(2)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华夏蓝筹混合(LOF)基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华夏蓝筹混合(LOF)基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏蓝筹混合(LOF)基金的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华夏蓝筹混合(LOF)基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华夏蓝筹混合(LOF)基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏蓝筹混合(LOF)基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对华夏蓝筹混合(LOF)基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致华夏蓝筹混合(LOF)基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师 单峰 赵雪
上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
2018年3月26日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:			
银行存款		-	-
结算备付金		130,969,199.71	743,576,957.70
存出保证金		650,937.50	1,520,995.63
交易性金融资产		4,276,947,653.58	3,485,211,750.99
其中:股票投资		4,022,791,038.58	3,460,399,004.89
基金投资		-	-
债券投资		254,156,615.00	24,812,746.10
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		99,922,269.88	-
应收证券清算款		-	6,111,874.06
应收利息		4,288,749.14	1,056,220.08
应收股利		-	-
应收申购款		404,099.52	3,327,558.33
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		4,513,182,909.33	4,240,805,356.79

负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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		-	104,820,874.62
应付赎回款		4,574,937.50	2,668,609.44
应付管理人报酬		5,652,008.32	5,327,307.90
应付托管费		942,001.37	887,884.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		19,854,927.06	21,685,647.30
应交税费		166,385.89	166,385.89
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,268,557.87	1,261,373.59
负债合计		32,458,818.01	136,818,083.39
所有者权益:			
实收基金		1,209,939,661.89	1,402,050,063.21
未分配利润		3,270,784,429.43	2,701,937,210.19
所有者权益合计		4,480,724,091.32	4,103,987,273.40
负债和所有者权益总计		4,513,182,909.33	4,240,805,356.79

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.588元,基金份额总额2,822,366,368.47份。

7.2 利润表

会计主体:华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入		1,130,356,330.88	-531,403,938.43
1.利息收入		13,827,019.71	14,608,038.82
其中:存款利息收入		5,357,674.31	10,045,998.62
债券利息收入		6,302,423.69	3,484,380.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,166,921.71	1,077,659.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		538,966,536.48	-193,276,298.80
其中:股票投资收益		483,606,233.40	-238,298,896.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-124,342.84	43,769.26
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		55,484,645.92	44,978,828.64
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		576,444,076.69	-353,346,027.50
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,118,698.00	610,349.05
减:二、费用		100,755,536.27	110,417,724.22
1.管理人报酬		65,539,607.23	64,299,137.29
2.托管费		10,923,267.85	10,716,522.91
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		22,576,337.27	34,954,621.28
5.利息支出		1,264,063.14	5,566.68
其中:卖出回购金融资产支出		1,264,063.14	5,566.68
6.其他费用		452,260.78	441,876.06
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,029,600,794.61	-641,821,662.65
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,029,600,794.61	-641,821,662.65

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31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)	1,402,050,063.21	2,701,937,210.19	4,103,987,273.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	1,029,600,794.61	1,029,600,794.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-192,110,401.32	-460,753,575.37	-652,863,976.69
其中:1.基金申购款	72,653,995.25	169,439,383.63	242,093,378.88
2.基金赎回款	-264,764,396.57	-630,192,959.00	-894,957,355.57
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)	1,209,939,661.89	3,270,784,429.43	4,480,724,091.32

项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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)	1,485,641,904.59	3,514,746,668.37	5,000,388,572.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-641,821,662.65	-641,821,662.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-83,591,841.38	-170,987,795.53	-254,579,636.91
其中:1.基金申购款	81,061,525.33	152,638,671.24	233,700,196.57
2.基金赎回款	-164,653,366.71	-323,626,466.77	-488,279,833.48
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)	1,402,050,063.21	2,701,937,210.19	4,103,987,273.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 关联方关系

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
交通银行股份有限公司("交通银行")	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
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东

注:①根据华夏基金管理有限公司于2017年9月29日发布的公告,经中国证监会核准,华夏基金管理有限公司股东变更为中信证券股份有限公司(出资比例62.2%),POWER CORPORATION OF CANADA(出资比例13.9%)、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION(出资比例13.9%)、青岛海鹏科技投资有限公司(更名为"天津海鹏科技咨询有限公司",出资比例10%)。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	1,814,431,686.57	11.62%	-	-

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 债券交易

无。

7.4.4.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	1,887,400,000.00	42.34%	-	-

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31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	1,326,893.01	10.13%	217,471.59	1.10%

关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	-	-	-	-

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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	65,539,607.23	64,299,137.29
其中:支付销售机构的客户维护费	13,274,544.66	13,074,216.77

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	10,923,267.85	10,716,522.91

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
期初持有的基金份额	57,727,975.27	57,727,975.27
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	57,727,975.27	-
期末持有的基金份额	-	57,727,975.27
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.77%

注:本基金管理人于本报告期赎回本基金,适用费率为0.5%。

7.4.4.4.2 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。

7.4.4.5 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	-	427,957.42	-	680,686.51

注:①本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

②除此之外,本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2017年12月31日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示(2016年12月31日;同)。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.5 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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

7.4.5.1.1 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
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	增发流通受限	11.06	53.21	46,098	509,843.88	2,452,874.58	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新发流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新发流通受限	16.