华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十九日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月27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2019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	华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华夏策略混合
基金主代码	002031
交易代码	002031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月23日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	214,365,303.16份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	通过灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,谋求基金资产的长期、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×55%+上证国债指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金是灵活配置型混合基金,混合基金的风险高于货币市场基金和债券基金,低于股票基金;而灵活配置型混合基金的资产配置比例可灵活调整,在混合基金中也属于较高风险、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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	王永民
	联系电话	400-818-6666	010-66594896
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区A区	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	刘连舸

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(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期已实现收益	65,648,309.50
本期利润	127,548,386.70
加权平均基金份额本期利润	0.5544
本期加权平均净值利润率	16.67%
本期基金份额净值增长率	17.49%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	525,630,849.09
期末可供分配基金份额利润	2.4520
期末基金资产净值	749,993,696.61
期末基金份额净值	3.499
3.1.3累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	375.39%

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。

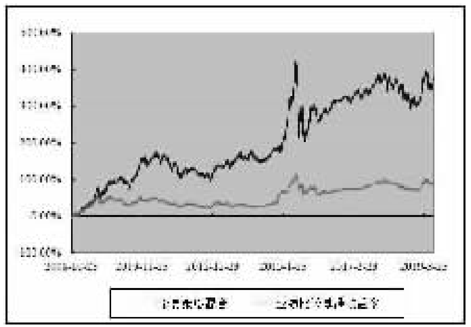
3.2基金净值表现

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	5.17%	0.87%	3.17%	0.65%	2.00%	0.22%
过去三个月	-1.05%	1.25%	-0.16%	0.84%	-0.89%	0.41%
过去六个月	17.49%	1.19%	15.53%	0.85%	1.96%	0.34%
过去一年	6.35%	1.20%	7.81%	0.84%	-1.46%	0.36%
过去三年	19.30%	0.91%	17.35%	0.61%	1.95%	0.30%
自基金合同生效起至今	375.39%	1.22%	93.21%	0.87%	282.18%	0.35%

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

华夏策略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
(2008年10月23日至2019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、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通ETF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。

华夏基金是境内ETF基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在ETF基金管理方面积累了丰富的经验,目前旗下管理华夏上证50ETF、华夏沪深300ETF、华夏MSCI中国A股国际通ETF、华夏恒生ETF、华夏沪港通恒生ETF、华夏野村日经225ETF、华夏中证500ETF、华夏中小板ETF、华夏创业板ETF、华夏中证央企ETF、华夏中证四川国改ETF、华夏战略新兴成指ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF、华夏创蓝筹ETF、华夏创成长ETF、华夏快线货币ETF及华夏3-5年中高级可质押信用债ETF,初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta策略、A股市场指数、海外市场指数及信用债指数等较为完整的产品线。

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2019年6月30日数据),华夏移动互联混合(QDII)在"QDII基金-QDII混合基金-QDII混合基金(A类)"中排序9/34;华夏稳增混合在"混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金(A类)"中排序8/27;华夏回报混合(H类)在"混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金(非A类)"中排序8/89;华夏鼎沛债券(A类)在"债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级)(A类)"中排序1/228;华夏理财30天债券(A类)在"债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金(摊余成本法)(A类)"中排序10/40;华夏恒融定开债券在"债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金(二级)(A类)"中排序7/19;华夏上证50AH优选指数(LOF)(A类) 在"股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(A类)"中排序8/29;华夏上证50AH优选指数(LOF)(C类)在"标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(非A类)"中排序4/11;华夏上证50ETF在"股票基金-股票ETF基金-规模指数股票ETF基金"中排序6/61;华夏消费ETF在"股票基金-股票ETF基金-行业指数股票ETF基金"中排序3/31;华夏沪深300ETF联接(C类)在"股票基金-股票ETF联接基金-规模指数股票ETF联接基金(非A类)"中排序9/34。

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。在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上,华夏安康债券、华夏收益债券(QDII)和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报QDII明星基金和2018年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中,华夏基金荣获"被动投资金牛基金公司"奖,华夏鼎茂债券(004042)荣获"2018年度开放式债券型金牛基金"奖,华夏中小板ETF(159902)荣获"2018年度开放式指数型金牛基金"奖。

在客户服务方面,2019年上半年度,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)华夏基金客服电话系统上线智能语音功能,客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金信息,同时系统还可以进行身份信息认证,主动告知业务办理进度,为客户提供全面、准确、便捷的服务,提升客户体验;(2)直销电子交易平台开通华夏惠利货币A的快速赎回业务,为广大投资者的资金使用提供便利;(3)与微众银行、华融湘江银行、紫金农商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"你的今年收益知否?知否?"、"你的户口本更新了"、"户龄"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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林晶	本基金的基金经理、投资研究部执行总经理	2017-03-07	-	14年	清华大学经济学硕士。2005年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任投资研究部研究员、基金经理助理、总经理助理、副总经理等。

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》等法律法规和基金合同,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

2019年一季度经历了货币政策明显放松和财政支出的前倾,经济数据出现短期企稳。但进入二季度之后,政策开始出现边际变紧。随着贸易摩擦进一步加剧,4-5月经济数据再次确认了下行态势。生产端,工业增加值进一步回落,库存进入主动去库存阶段,出口导向的前瞻指标仍然趋弱。从需求分解看,基建增速小幅反弹但低于预期,地产投资需求处于较高位置,制造业投资持续下行,6月份后政府再次出台专项债提供资本金等政策来刺激基建投资;消费整体呈现缓慢下行,其中必选消费保持韧性,但可选消费则明显下降。中美贸易摩擦问题出现反复,有谈判长期化以及扩散至科技封锁的趋势。货币环境方面,由于个别中小银行的流动性问题,央行对市场注入较多流动性,整体市场回购利率持续走低,不同类型金融机构融资环境出现明显分层。

上半年,A股市场经历了1季度的快速上涨和2季度的调整及横盘整理,总体看来仍有较好的涨幅。1季度,信贷及社会融资总额快速增长,市场无风险利率不断下行,风险偏好维持较高水平,股票市场估值明显提升。但伴随着1季度经济数据企稳后政策出现明显转向收紧,以及贸易摩擦出现反复,股票市场出现了明显回调。行业和个股分化加大,猪瘟扩散加速了生猪产能去化,推动养殖行业盈利出现拐点,养殖行业表现突出;以白酒、保险、免税、银行等为代表的核心资产受到投资者追捧,表现较好;与贸易摩擦及科技封锁相关的电子、通信则波动较大;进入6月,随着美联储降息概率逐渐加大,黄金价格出现明显上涨,黄金相关股票表现突出。

报告期内,本基金股票仓位先升后降,降低了公用事业、建筑装饰、电气设备等行业配置,增加了保险、通信、食品饮料、商贸零售、黄金行业配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日,本基金份额净值为3.499元,本报告期份额净值增长率为17.49%,同期业绩比较基准增长率为15.53%。

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,国内外经济仍有下行压力,三季度受外需影响下降压力较大,四季度有望缓和。中美贸易摩擦仍是潜在影响变量,目前阶段国内政策会为中长期经济转型压力及复杂的国际环境留有调整空间,不会大水漫灌或者猛烈去杠杆,政策会随着经济变化趋势和中美谈判进展相机抉择。金融供给侧改革会加速资本市场分化,资质较差的公司仍需消化宏观经济下滑的风险,而业绩稳健的龙头蓝筹公司会继续受到资金抱团取暖。

本基金在下半年会保持中性仓位,将继续持有行业龙头蓝筹公司,以及与宏观经济相关度较弱的行业及优质个股,力争为基金持有人获得稳健回报。

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		-	-
银行存款		157,066,719.67	60,854,039.44
结算备付金		3,092,755.65	1,222,915.50
存出保证金		171,525.80	102,808.55
交易性金融资产		598,238,250.73	467,110,127.14
其中:股票投资		498,662,054.57	421,539,063.80
基金投资		-	-
债券投资		99,576,196.16	45,571,063.34
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		-	190,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,081,520.17	773,888.59
应收股利		-	-
应收申购款		108,350.12	15,100,307.46
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		759,759,122.14	735,164,086.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		3,937,597.13	3,046,483.75
应付赎回款		1,074,167.59	212,012.49
应付管理人报酬		894,694.06	928,892.03
应付托管费		149,115.70	154,815.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,933,868.50	2,538,629.98
应交税费		680,479.07	680,405.10
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		95,503.48	70,780.37
负债合计		9,765,425.53	7,632,019.08
所有者权益:		-	-
实收基金		214,365,303.16	244,321,004.37
未分配利润		535,628,393.45	483,211,063.23
所有者权益合计		749,993,696.61	727,532,067.60
负债和所有者权益总计		759,759,122.14	735,164,086.68

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值3.499元,基金份额总额214,365,303.16份。

6.2利润表

会计主体:华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		136,514,687.24	-32,814,038.33
1.利息收入		1,370,657.05	2,097,175.57
其中:存款利息收入		595,770.30	316,228.80
债券利息收入		580,305.05	1,755,224.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		194,581.70	25,722.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		73,040,290.81	7,799,398.78
其中:股票投资收益		70,346,540.92	4,989,715.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,188,264.65	-1,686,411.11
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		3,882,014.54	4,496,094.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		61,900,077.20	-42,910,317.05
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		203,662.18	199,704.37
减:二、费用		8,966,300.54	8,660,767.94
1.管理人报酬		5,679,666.70	5,997,629.15
2.托管费		946,611.08	999,604.90
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		2,221,709.28	1,563,877.41
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		48.19	360.58
7.其他费用		118,265.29	99,295.90
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		127,548,386.70	-41,474,806.27
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		127,548,386.70	-41,474,806.27

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	244,321,004.37	483,211,063.23	727,532,067.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	127,548,386.70	127,548,386.70
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)	-29,955,701.21	-75,131,056.48	-105,086,757.69
其中:1.基金申购款	15,375,239.46	35,878,704.05	51,253,943.51
2.基金赎回款	-45,330,940.67	-111,009,760.53	-156,340,701.20
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)	214,365,303.16	535,628,393.45	749,993,696.61
项目	上年度可比期间 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)	248,737,179.07	614,736,150.49	863,473,329.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-41,474,806.27	-41,474,806.27
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)	-21,010,866.57	-51,701,860.37	-72,712,726.94
其中:1.基金申购款	24,363,354.64	59,398,218.23	83,761,572.87
2.基金赎回款	-45,374,221.21	-111,100,078.60	-156,474,299.81
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)	227,726,312.50	521,559,483.85	749,285,796.35

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:朱威,会计机构负责人:朱威

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
中国银行股份有限公司("中国银行")	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	297,086,257.21	18.31%	158,537,532.18	14.44%

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	10,731,387.50	0.18%	2,230,243.00	3.40%

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	500,000,000.00	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 2019年1月1日至2019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	263,368.38	21.32%	263,368.38	8.98%
关联方名称	上年度可比期间 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	141,528.41	16.24%	141,528.41	5.34%

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,679,666.70	5,997,629.15
其中:支付销售机构的客户维护费	741,124.81	761,655.30

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	946,611.08	999,604.90

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国银行活期存款	157,066,719.67	579,088.96	121,136,530.49	307,884.28

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管,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。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5期末(2019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
000063	中兴通讯	2019-03-28	2019-09-27	非公开发行流通受限	24.00	30.50	500,000	12,000,000.00	15,250,000.00	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新发流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

注:①以上"可流通日"是根据上市公司公告估算的流通日期,最终日期以上市公司公告为准。

②基金可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份,所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》,本基金持有的上市公司非公开发行股份,自股份解除限售之日起12个月内,通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%;采取大宗交易方式的,在任意连续90日内,减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。

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2019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523,122,250.73元,第二层次的余额为75,116,000.00元,第三层次的余额为0元。(截至2018年12月31日止:第一层次的余额为425,219,923.64元,第二层次的余额为41,890,203.50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	498,662,054.57	65.63
	其中:股票	498,662,054.57	65.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	99,576,196.16	13.11
	其中:债券	99,576,196.16	13.11
	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	160,159,475.32	21.08
8	其他各项资产	1,361,396.09	0.18
9	合计	759,759,122.14	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	30,991,927.87	4.13
C	制造业	206,491,312.58	27.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,275,704.83	2.17
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,771,973.00	2.64
G	交通运输、仓储和邮政业	21,708,121.57	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,771,849.80	5.30
J	金融业	95,686,030.94	12.76
K	房地产业	32,035,501.16	4.27
L	租赁和商务服务业	10,821,505.50	1.44
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	7,881,741.12	1.05
R	文化、体育和娱乐业	17,226,386.20	2.30
S	综合	-	-
	合计	498,662,054.57	66.49

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	36,100	35,522,400.00	4.74
2	601318	中国平安	375,700	33,290,777.00	4.44
3	601688	华泰证券	1,282,100	28,616,472.00	3.82
4	600867	通化东宝	1,354,040	20,852,216.00	2.78
5	601601	中国太保	520,700	19,010,757.00	2.53
6	000063	中兴通讯	607,255	18,739,005.15	2.50
7	300413	芒果超媒	419,644	17,226,386.20	2.30
8	600547	山东黄金	377,000	15,521,090.00	2.07
9	002475	立讯精密	607,756	15,066,271.24	2.01
10	603659	璞泰来	262,841	12,358,783.82	1.65

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	37,452,697.00	5.15
2	601336	新华保险	30,477,389.74	4.19
3	000063	中兴通讯	27,246,778.45	3.75
4	000001	平安银行	25,017,940.20	3.44
5	601318	中国平安	24,263,251.14	3.34
6	601688	华泰证券	19,436,680.69	2.67
7	600547	山东黄金	18,603,349.00	2.56
8	601111	中国国航	17,713,708.10	2.43
9	601601	中国太保	15,025,081.00	2.07
10	002146	荣盛发展	13,081,945.46	1.80
11	002373	千方科技	12,905,378.75	1.77
12	002475	立讯精密	12,862,873.94	1.77
13	300498	温氏股份	12,497,611.85	1.72
14	603369	今世缘	11,804,160.82	1.62
15	600104	上汽集团	11,657,096.56	1.60
16	600116	三峡水利	10,381,118.26	1.43
17	300750	宁德时代	10,315,545.00	1.42
18	600325	华发股份	10,011,251.80	1.38
19	600967	内蒙一机	9,885,989.90	1.36
20	000401	冀东水泥	9,820,740.00	1.35

注:"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601336	新华保险	27,164,499.68	3.73
2	000001	平安银行	26,137,413.55	3.59
3	601318	中国平安	25,463,307.82	3.50
4	300498	温氏股份	21,482,505.24	2.95
5	600011	华能国际	20,617,504.54	2.83
6	603659	璞泰来	18,877,522.19	2.59
7	000063	中兴通讯	18,231,024.46	2.51
8	601888	中国国旅	15,452,127.89	2.12
9	600519	贵州茅台	15,189,404.04	2.09
10	600027	华电国际	14,869,771.91	2.04
11	002202	金风科技	14,839,376.79	2.04
12	002867	周大生	14,530,584.39	2.00
13	002157	正邦科技	12,979,451.87	1.78
14	600104	上汽集团	12,828,538.92	1.76
15	002373	千方科技	12,683,770.00	1.74
16	600036	招商银行	12,440,927.81	1.71
17	300750	宁德时代	11,544,262.77	1.59
18	603096	新经典	11,258,948.40	1.55
19	601155	新城控股	11,148,409.34	1.53
20	601933	永辉超市	10,664,635.62	1.47

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	786,600,919.02
卖出股票的收入(成交)总额	841,465,558.67

注:"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	40,032,000.00	5.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,834,000.00	2.64
	其中:政策性金融债	19,834,000.00	2.64
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)	39,710,196.16	5.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	99,576,196.16	13.28

7.6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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180018	18附息国债18	400,000	40,032,000.00	5.34
2	100213	10国开13	200,000	19,834,000.00	2.64
3	127010	平银转债	126,626	15,082,422.86	2.01
4	110049	海尔转债	85,000	10,227,200.00	1.36
5	113529	绝味转债	59,130	7,624,813.50	1.02

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9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。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1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。

7.10.2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。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1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。

7.11.2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。

7.11.3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。

7.12投资组合报告附注

7.12.1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。

7.12.2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。

7.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	171,525.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,081,520.17
5	应收申购款	108,350.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,361,396.09

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110049	海尔转债	10,227,200.00	1.36
2	113019	玲珑转债	3,680,377.00	0.49
3	110040	生益转债	2,660,600.00	0.35
4	113523	伟明转债	434,782.80	0.06

7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000063	中兴通讯	15,250,000.00	2.03	重大事项

7.12.6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。

§8 基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
20,036	10,699.01	14,804,595.64	6.91%	199,560,707.52	93.09%

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	96,496.46	0.05%

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年10月23日)基金份额总额	1,583,765,847.96
本报告期期初基金份额总额	244,321,004.37
本报告期基金总申购份额	15,375,239.46
减:本报告期基金总赎回份额	45,330,940.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	214,365,303.16

§10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2019年3月2日发布公告,李彬女士担任华夏基金管理有限公司督察长,周璇女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

2019年5月,陈四清先生因工作调动,辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
南京证券	1	551,195,580.90	33.96%	403,088.97	32.63%	-
国盛证券	1	441,381,824.59	27.20%	322,781.74	26.13%	-
中信证券	2	297,086,257.21	18.31%	263,368.38	21.32%	-
东北证券	1	111,214,315.61	6.85%	81,331.14	6.58%	-
海通证券	1	70,633,315.14	4.35%	51,653.28	4.18%	-
中国银河证券	1	65,951,830.86	4.06%	48,230.49	3.90%	-
中金公司	1	44,470,005.84	2.74%	32,520.58	2.63%	-
东方证券	1	28,975,215.30	1.79%	21,188.35	1.71%	-
兴业证券	1	12,000,000.00	0.74%	11,350.92	0.92%	-

注:①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

ⅰ经营行为规范,在近一年内无重大违规行为。

ⅱ公司财务状况良好。

ⅲ有良好的内控制度,在业内有良好的声誉。

ⅳ有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告。

ⅴ建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序:

ⅰ对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。

ⅱ协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

③除本表列示外,本基金还选择了国信证券、国泰君安证券、中信建投证券、申万宏源证券、西部证券、银河证券、中银国际证券、高华证券、瑞银证券、华泰证券、招商证券、太平洋证券、天风证券、平安证券、方正证券、万和证券、西藏东方财富证券、金通证券、东吴证券的交易单元作为本基金交易单元,本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中,中信证券的部分交易单元、华泰证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
南京证券	19,029,021.14	32.20%	-	-
国盛证券	28,607,001.73	48.41%	-	-
中信证券	10,731,387.50	18.16%	500,000,000.00	100.00%
东北证券	184,496.09	0.31%	-	-
海通证券	536,174.60	0.91%	-	-
中国银河证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1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。

华夏基金管理有限公司
二〇一九年八月二十九日