

上证金融地产交易型开放式指数  
发起式证券投资基金  
2016 年半年度报告

2016 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

## §1 重要提示及目录

### 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，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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	28
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	30
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
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.....	32
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.....	32
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.....	32
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.....	32
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	32
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	32
7.12 投资组合报告附注.....	32
§8 基金份额持有人信息.....	33
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	33
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	33
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	34
8.4 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情况.....	34
8.5 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	34
§9 开放式基金份额变动.....	34
§10 重大事件揭示.....	35
§11 备查文件目录.....	37

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金简称	华夏金融 ETF
场内简称	金融行业
基金主代码	510650
交易代码	510650
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 28 日
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
报告期末基金份额总额	42,952,472 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 5 月 8 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等原因导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证金融地产行业指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096

电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话	400-818-6666	010-67595096
传真	010-63136700	010-66275853
注册地址	北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-2,141,507.87
本期利润	-16,077,919.26
加权平均基金份额本期利润	-0.2173
本期加权平均净值利润率	-15.98%
本期基金份额净值增长率	-10.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	6,866,311.43
期末可供分配基金份额利润	0.1599
期末基金资产净值	59,642,387.07
期末基金份额净值	1.3886
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	38.86%

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	-1.45%	0.69%	-2.11%	0.73%	0.66%	-0.04%
过去三个月	-0.28%	0.80%	-0.87%	0.81%	0.59%	-0.01%
过去六个月	-10.38%	1.55%	-10.98%	1.57%	0.60%	-0.02%
过去一年	-19.97%	2.14%	-21.57%	2.16%	1.60%	-0.02%
过去三年	56.60%	2.00%	50.95%	2.02%	5.65%	-0.02%
自基金合同生效起至今	38.86%	1.96%	26.17%	2.01%	12.69%	-0.05%

#### 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

上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金  
 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

(2013年3月28日至2016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，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 10 只 ETF 产品，分别为华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中证 500ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏恒生 ETF 和华夏沪港通恒生 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的 ETF 产品线。

在《中国证券报》主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2015 年度被动投资金牛基金公司”奖。在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中，华夏基金获得“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”奖。

在客户服务方面，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）实现资产证明和对账单自动获取，客户可以自助提交申请并查询办理进度，业务处理更加高效；（2）网上交易平台上线交通银行、招商银行、民生银行、邮政储蓄银行等快捷支付方式和华夏财富系统，并与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财，拓宽客户交易通道，增加交易便利性；（3）开展“130 万人定投的华夏红利”、“客户个性化白皮书”、“你定，我投”、“书写华夏印象，见证一个行业”等活动，为客户提供多样化的关怀服务。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王路	本基金的基金经理、数量投资部执行总经理、首席量化投资官	2013-03-28	-	18 年	博士。曾任美国纽约德意志资产管理公司基金经理及定量股票研究负责人、美国纽约法兴银行组合经理、大成基金国际业务部副总监等。2008 年 11 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部总经理等。
徐猛	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2013-04-08	-	13 年	清华大学工学硕士。曾任财富证券助理研究员，原中关村证券研究员等。2006 年 2 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部基金经理助理等。

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合规守信情况的说明

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

本基金跟踪的标的指数为上证金融地产行业指数，是上证行业指数系列的组成部分。上证行业指数选择上海证券交易所各行业中规模大、流动性好的股票组成样本股，自 2009 年 1 月 9 日起正式发布，以反映上海证券交易所不同行业公司股票的整体表现。本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

上半年，国际方面，美国经济基本面相对稳健，围绕对美联储加息节奏的预测，新兴市场汇率出现较大波动。英国脱欧给国际金融市场带来较大的动荡。国内方面，经济依然较弱，增长动能不足，政府积极调整结构，化解过剩产能，消化房地产库存。同时央行采取了降准、提高财政支出等政策。在经济数据整体不佳的背景下，通胀预期有所降温。

市场方面，年初由于美联储加息预期较强，人民币短期快速贬值，资金流出压力加剧，A 股市场出现较大跌幅，随后在政府的积极干预下，市场逐步企稳并呈震荡走势。报告期内，上证金融地产行业指数下跌 10.98%，表现略高于市场平均水平。从成份股报告期表现分析，对指数正贡献最大的是国投安信，对指数负贡献最大的是中国平安。

基金投资运作方面，报告期内，本基金进行了成份股的定期调整，在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国信证券股份有限公司等。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3886 元，本报告期份额净值增长率为-10.38%，同期上证金融地产行业指数增长率为-10.98%。本基金本报告

期跟踪偏离度为+0.60%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 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，国际方面，预计美国经济将继续温和增长，美元的加息节奏仍是牵动市场神经的关键因素。国内方面，政府将切实推进供给侧结构性改革，预计会有一些实质性的改革举措陆续落地；同时为应对宏观经济持续走弱，政府将继续出台一系列稳增长措施。在信用风险频发的背景下，国内的大类资产配置或将逐步倾向股票市场。如果经济或政策超预期，市场情绪有望继续恢复，A股市场有望呈震荡上涨走势，代表低估值金融蓝筹股的上证金融地产行业指数或有相对较好的表现。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥ETF的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所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模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同规定，本基金收益分配应遵循下列原则：本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金收益分配采用现金方式。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 2 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。法律法规、监管机构、登记结算机构、上海证券交易所另有规定的从其规定。

本基金本报告期末未进行利润分配，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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## §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：上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,024,620.70	1,631,649.54
结算备付金		6,928.57	1,802.86
存出保证金		3,108.13	18,512.88
交易性金融资产	6.4.7.2	58,751,225.14	127,113,513.48
其中：股票投资		58,751,225.14	127,113,513.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	239.85	262.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		59,786,122.39	128,765,741.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,165.15
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		29,068.64	55,257.55

应付托管费		5,813.71	11,051.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,018.09	31,128.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	105,834.88	130,000.00
负债合计		143,735.32	234,602.76
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	42,952,472.00	82,952,472.00
未分配利润	6.4.7.10	16,689,915.07	45,578,666.67
所有者权益合计		59,642,387.07	128,531,138.67
负债和所有者权益总计		59,786,122.39	128,765,741.43

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3886 元，基金份额总额 42,952,472 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-15,653,437.51	21,791,421.63
1.利息收入		4,850.42	22,307.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,850.42	22,307.03
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,684,647.68	24,915,552.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,427,941.32	21,060,653.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	743,293.64	3,854,898.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-13,936,411.39	-2,854,288.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-37,228.86	-292,149.11
<b>减：二、费用</b>		424,481.75	1,957,626.15
1.管理人报酬		251,286.26	1,333,922.23
2.托管费		50,257.21	266,784.37
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	15,853.53	183,132.41
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.21	107,084.75	173,787.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,077,919.26	19,833,795.48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-16,077,919.26	19,833,795.48

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	82,952,472.00	45,578,666.67	128,531,138.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,077,919.26	-16,077,919.26
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）	-40,000,000.00	-12,810,832.34	-52,810,832.34
其中：1.基金申购款	144,000,000.00	55,504,674.37	199,504,674.37
2.基金赎回款	-184,000,000.00	-68,315,506.71	-252,315,506.71
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）	42,952,472.00	16,689,915.07	59,642,387.07
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	313,452,472.00	212,944,341.92	526,396,813.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,833,795.48	19,833,795.48
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）	-99,500,000.00	-75,508,835.56	-175,008,835.56
其中：1.基金申购款	12,956,000,000.00	9,516,399,015.95	22,472,399,015.95
2.基金赎回款	-13,055,500,000.00	-9,591,907,851.51	-22,647,407,851.51
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）	213,952,472.00	157,269,301.84	371,221,773.84

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：

          杨明辉  汪贵华  汪贵华            
 基金管理人负责人          主管会计工作负责人          会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1225号《关于核准上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2013 年 2 月 25 日至 2013 年 3 月 22 日期间共募集 1,096,370,065.00 元（不含认购资金

利息)，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（13）第 0045 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,096,452,472 份基金份额，其中认购资金利息折合 82,407 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明



本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3、存款利息收入不征收增值税。

4、国债、地方政府债及政策性金融债券利息收入、质押式买入返售金融商品利息收入、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税。

5、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。

6、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	1,024,620.70
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,024,620.70

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	58,914,953.22	58,751,225.14	-163,728.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	58,914,953.22	58,751,225.14	-163,728.08

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	235.35
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3.10
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.40
合计	239.85

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,018.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,018.09

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	89,507.60
应付指数使用费	16,327.28
合计	105,834.88

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	82,952,472.00	82,952,472.00

本期申购	144,000,000.00	144,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-184,000,000.00	-184,000,000.00
本期末	42,952,472.00	42,952,472.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,067,551.78	30,511,114.89	45,578,666.67
本期利润	-2,141,507.87	-13,936,411.39	-16,077,919.26
本期基金份额交易产生的变动数	-6,059,732.48	-6,751,099.86	-12,810,832.34
其中：基金申购款	23,810,468.31	31,694,206.06	55,504,674.37
基金赎回款	-29,870,200.79	-38,445,305.92	-68,315,506.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,866,311.43	9,823,603.64	16,689,915.07

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	4,575.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	253.35
其他	21.08
合计	4,850.42

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-360,884.89
股票投资收益——赎回差价收入	-2,067,056.43
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-2,427,941.32

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日
卖出股票成交总额	10,796,788.54
减：卖出股票成本总额	11,157,673.43
买卖股票差价收入	-360,884.89

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	252,315,506.71
减：现金支付赎回款总额	2,837,553.71
减：赎回股票成本总额	251,545,009.43
赎回差价收入	-2,067,056.43

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.3 贵金属投资——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.4 贵金属投资——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本报告期无其他衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	743,293.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	743,293.64

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-13,936,411.39
——股票投资	-13,936,411.39
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-13,936,411.39

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-37,228.86
合计	-37,228.86

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	15,853.53
银行间市场交易费用	-

合计	15,853.53
----	-----------

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
上市费	29,835.26
指数使用费	16,327.28
银行费用	1,249.87
合计	107,084.75

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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、申购赎回代办券商

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	251,286.26	1,333,922.23

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 0.5% 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 × 0.5% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	50,257.21	266,784.37

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 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况



本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
中信证券股份有限公司	230,494.00	0.54%	10,487,374.00	12.64%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

#### 6.4.10.5 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 2016年1月1日至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至 2015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
中国建设银行 活期存款	1,024,620.70	4,575.99	6,256,647.49	11,939.72

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有需披露的暂时停牌股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正

回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其

余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合 Beta 值等指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用 Beta 值等指标来衡量市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	58,751,225.14	98.51	127,113,513.48	98.90
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	58,751,225.14	98.51	127,113,513.48	98.90

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为上证金融地产行业指数变动时，各类持仓资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	2、假定上证金融地产行业指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。
	3、Beta 系数是根据组合在报表日各类持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指

	数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	+5%	3,139,575.26	6,375,787.13
	-5%	-3,139,575.26	-6,375,787.13

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2016 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 58,751,225.14 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。

（截至 2015 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 127,113,513.48 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。）

##### 6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于收盘价异常的债券，本基金将相关债券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，于债券收盘价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。对于在证券交易所上市

或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 本基金于 2015 年 3 月 20 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值, 并将其公允价值从第一层次调整至第二层次。

#### 6.4.14.4 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	58,751,225.14	98.27
	其中: 股票	58,751,225.14	98.27
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	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	-	-
	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	1,031,549.27	1.73
7	其他各项资产	3,347.98	0.01
8	合计	59,786,122.39	100.00

注: 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	56,437,977.32	94.63
K	房地产业	2,313,247.82	3.88
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	58,751,225.14	98.51

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	248,310	7,955,852.40	13.34
2	600016	民生银行	554,885	4,955,123.05	8.31
3	601166	兴业银行	304,233	4,636,510.92	7.77
4	600036	招商银行	231,181	4,045,667.50	6.78
5	600000	浦发银行	231,051	3,597,464.07	6.03
6	601328	交通银行	584,958	3,293,313.54	5.52
7	600030	中信证券	176,900	2,871,087.00	4.81
8	601288	农业银行	888,351	2,842,723.20	4.77
9	600837	海通证券	180,719	2,786,686.98	4.67
10	601398	工商银行	535,267	2,376,585.48	3.98
11	601169	北京银行	228,884	2,373,527.08	3.98
12	601601	中国太保	69,535	1,880,226.40	3.15
13	601988	中国银行	474,470	1,523,048.70	2.55
14	601688	华泰证券	80,038	1,514,318.96	2.54
15	601818	光大银行	356,418	1,340,131.68	2.25
16	600999	招商证券	79,422	1,310,463.00	2.20
17	600048	保利地产	149,702	1,291,928.26	2.17
18	600015	华夏银行	117,106	1,158,178.34	1.94

19	600958	东方证券	62,100	1,043,901.00	1.75
20	601628	中国人寿	47,127	981,184.14	1.65
21	601336	新华保险	20,029	809,171.60	1.36
22	601901	方正证券	104,368	799,458.88	1.34
23	601211	国泰君安	36,000	640,440.00	1.07
24	600705	中航资本	93,180	547,898.40	0.92
25	600340	华夏幸福	22,212	541,528.56	0.91
26	601788	光大证券	26,100	442,134.00	0.74
27	600663	陆家嘴	17,380	395,395.00	0.66
28	601998	中信银行	63,500	360,045.00	0.60
29	600061	国投安信	19,800	352,836.00	0.59
30	600606	绿地控股	7,800	84,396.00	0.14

#### 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	600999	招商证券	1,348,100.00	1.05
2	601377	兴业证券	1,128,034.63	0.88
3	600837	海通证券	1,032,513.00	0.80
4	601601	中国太保	940,800.00	0.73
5	600958	东方证券	930,700.00	0.72
6	601288	农业银行	861,400.00	0.67
7	600016	民生银行	806,400.00	0.63
8	601398	工商银行	749,700.00	0.58
9	601628	中国人寿	706,860.00	0.55
10	601328	交通银行	619,300.00	0.48
11	600048	保利地产	574,306.28	0.45
12	601901	方正证券	550,200.00	0.43
13	600705	中航资本	499,500.00	0.39
14	600036	招商银行	474,000.00	0.37
15	600061	国投安信	415,132.00	0.32
16	601336	新华保险	320,000.00	0.25
17	601688	华泰证券	283,470.00	0.22
18	601198	东兴证券	255,880.00	0.20
19	600606	绿地控股	115,300.00	0.09
20	-	-	-	-

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	600016	民生银行	2,159,835.90	1.68
2	601601	中国太保	1,584,425.18	1.23
3	600837	海通证券	1,320,995.00	1.03
4	601377	兴业证券	1,173,800.32	0.91
5	601288	农业银行	888,000.00	0.69
6	600999	招商证券	830,696.14	0.65
7	600048	保利地产	660,100.00	0.51
8	600705	中航资本	634,000.00	0.49
9	601398	工商银行	598,267.00	0.47
10	601198	东兴证券	370,512.00	0.29
11	601628	中国人寿	225,936.00	0.18
12	600036	招商银行	177,900.00	0.14
13	600663	陆家嘴	125,421.00	0.10
14	601169	北京银行	46,900.00	0.04
15	-	-	-	-
16	-	-	-	-
17	-	-	-	-
18	-	-	-	-
19	-	-	-	-
20	-	-	-	-

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	12,611,595.91
卖出股票收入（成交）总额	10,796,788.54

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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 2015 年 9 月 10 日海通证券收到了中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚事先告知书》。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，海通证券系标的指数成份股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

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	3,108.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	239.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,347.98

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 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
1,329	32,319.39	5,488,553.00	12.78%	37,463,919.00	87.22%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	欧明媚	3,642,000	8.48%
2	梁桐灿	2,038,000	4.74%
3	许玉善	1,532,800	3.57%
4	恒安标准人寿保险有限公司—传统	1,339,200	3.12%

	分红险		
5	信诚人寿保险有限公司	1,300,000	3.03%
6	宫宏宇	1,000,000	2.33%
7	中国银河证券股份有限公司	805,496	1.88%
8	罗月中	749,000	1.74%
9	王鹤龄	629,700	1.47%
10	陈则君	600,000	1.40%

### 8.3 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	-	-

### 8.4 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

### 8.5 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

金额单位：人民币元

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	230,494	0.54%	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	230,494	0.54%	-	-	-

注：截至 2016 年 3 月 28 日，上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年3月28日）基金份额总额	1,096,452,472
本报告期期初基金份额总额	82,952,472
本报告期基金总申购份额	144,000,000

减：本报告期基金总赎回份额	184,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	42,952,472

## §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

根据本基金管理人发布的相关公告，孙毅先生自 2016 年 1 月 1 日起任华夏基金管理有限公司副总经理，自 2016 年 6 月 30 日起不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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未受到任何处分。

### 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	
国泰君安证券	2	22,985,149.82	100.00%	3,018.09	100.00%	-

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，本基金还选择了光大证券、海通证券、申万宏源证券、中国银河证券、中信建投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 本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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
-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
3	华夏基金管理有限公司关于指数熔断期间旗下基金场内申赎业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-05
4	华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-07
5	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-13
6	华夏基金管理有限公司关于设立上海华	中国证监会指	2016-01-30

	夏财富投资管理有限公司的公告	定报刊及网站	
7	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-04
8	华夏基金管理有限公司关于新增上证医药等三只交易型开放式指数发起式证券投资基金申购赎回代办券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-17

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

11.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

11.1.2 《上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》；

11.1.3 《上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》；

11.1.4 法律意见书；

11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 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。

### 11.3 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

二〇一六年八月二十七日