

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

2017 年半年度报告

2017 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 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.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
§12 备查文件目录.....	45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深 300ETF
场内简称	华夏 300
基金主代码	510330
交易代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 25 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,360,749,828 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 1 月 16 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。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深 300 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
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 55 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 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		杨明辉	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	112,235,318.86
本期利润	1,864,149,617.84
加权平均基金份额本期利润	0.4157
本期加权平均净值利润率	11.29%
本期基金份额净值增长率	11.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	6,550,033,954.21
期末可供分配基金份额利润	1.5020
期末基金资产净值	17,203,526,021.53
期末基金份额净值	3.9451
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	66.96%

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	5.61%	0.65%	4.98%	0.68%	0.63%	-0.03%
过去三个月	6.99%	0.61%	6.10%	0.62%	0.89%	-0.01%
过去六个月	11.84%	0.56%	10.78%	0.57%	1.06%	-0.01%

过去一年	19.19%	0.66%	16.26%	0.67%	2.93%	-0.01%
过去三年	81.73%	1.74%	69.36%	1.75%	12.37%	-0.01%
自基金合同生效起至今	66.96%	1.61%	53.99%	1.61%	12.97%	0.00%

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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
 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
 (2012 年 12 月 25 日至 2017 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,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、华夏沪港通恒生 ETF 和华夏快线 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、海外市场指数等的产品线。今年 6 月，A 股成功纳入 MSCI 新兴市场指数，作为境内率先推出的跟踪 MSCI 中国 A 股指数的 ETF 基金，华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 受到市场广泛关注。

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。

在客户服务方面，2017 年上半年，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）下调旗下开放式基金在直销机构及华夏财富的申购、赎回等业务最低数量限制，更好地满足客户理财需求；（2）新增开通华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币网上交易快速赎回业务，并且将单日单账户快速赎回份额上调至 50 万份，更好地满足了投资者的流动性需求；（3）网上交易上线中信银行和广发银行快捷支付业务，并与花旗银行、青岛农商银行、国美基金等代销机构合作，拓宽客户交易渠道，提高客户交易便利性；（4）开展“华夏基金 19 周年司庆”、“4 月万物生长，定投让理财生花”、“知识就是红包”等多项客户活动，为客户提供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		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2012-12-25	-	17 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理，上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）等。
赵宗庭	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2017-04-17	-	9 年	对外经济贸易大学经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。

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沪深 300 指数，沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，国际方面，随着终端消费需求改善，私人部门投资回暖，内生增长动力增强，美国经济持续复苏，美联储连续加息两次；伴随政治风险减退，信心指数和景气指数上升，欧洲经济逐渐复苏。国内方面，经济运行延续了稳中向好的态势，稳的格局更加巩固，好的态势更加明显，总体形势好于预期；供给侧结构性改革稳步推进，工业经济增长动力逐步增强；投资结构持续优化，制造业投资、民间投资增速回升；居民收入与经济同步增长，消费结构加快升级，消费继续发挥经济增长主要动力的作用；战略性新兴、高技术产业等新兴行业继续保持较高增长，成为推动经济稳步增长的重要动力。

市场方面，1 季度 A 股市场延续了去年下半年震荡向上的趋势行情，进入 4 月后，大盘指数开始回落，沪深两市成交疲软；5 月上旬行情步入低谷，资金开始青睐蓝筹股，大盘股与中小盘股走势有所分化；6 月，在 A 股纳入 MSCI 以及较为宽松的货币政策等因素的刺激下，市场走出一波反弹行情。

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回以及成份股调整等工作。

为进一步促进本基金的市场流动性和平稳运行，报告期内，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、中国国际金融有限公司、招商证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、 联讯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 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 3.9451 元，本报告期份额净值增长率为 11.84%，同期沪深 300 指数增长率为 10.78%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.06%，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

下半年，国际方面，在经济保持平稳增长的前提下，美国预期还会加息一次，利率抬升一定程度后美联储或将启动缩表程序；英国脱欧对欧洲的负面影响继续消散，短期政治风险继续减弱，但欧洲经济走势仍存在不确定性。国内方面，在供给侧结构性改革深入实施、创新驱动发展战略加快推进的背景下，我国实体经济运行当中的积极变化还会继续增加，稳中向好的发展态势将会进一步巩固和扩大；货币政策仍会维持上半年的中性偏紧的态势，在金融去杠杆及严监管之下，股市的推动因素基本面重于资金面，但整体宏观环境仍然利好股市，在基本面继续向好的情况下，沪深 300 指数将会有较好的投资机会。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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，本基金的收益分配原则为：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 4 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。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末进行利润分配，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，本基金托管人在对华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	230,349,200.29	407,816,857.87
结算备付金		201,091,276.18	529,246,153.97
存出保证金		83,136,604.56	268,760,830.89
交易性金融资产	6.4.7.2	16,700,276,805.39	14,753,399,336.38
其中：股票投资		16,693,907,587.19	14,746,925,352.88
基金投资		-	-
债券投资		6,369,218.20	6,473,983.50
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	160,000,000.00	-
应收证券清算款		1,695,212.19	197,688,426.75
应收利息	6.4.7.5	133,651.52	357,804.59
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		17,376,682,750.13	16,157,269,410.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		162,209,891.28	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,878,516.98	7,016,699.11
应付托管费		1,375,703.40	1,403,339.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	953,902.42	866,780.06
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	1,738,714.52	3,066,442.61
负债合计		173,156,728.60	12,353,261.58
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	10,653,492,067.32	11,181,188,994.97
未分配利润	6.4.7.10	6,550,033,954.21	4,963,727,153.90
所有者权益合计		17,203,526,021.53	16,144,916,148.87
负债和所有者权益总计		17,376,682,750.13	16,157,269,410.45

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.9451 元，基金份额总额 4,360,749,828 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		1,917,813,225.67	-2,493,564,704.90
1.利息收入		7,574,851.73	7,420,828.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,721,512.24	7,412,185.79
债券利息收入		17,783.07	8,643.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		835,556.42	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		157,602,565.27	-107,146,470.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-57,115,538.54	-146,208,093.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	565,728.67	308,714.12
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	78,454,443.16	-97,096,140.00
股利收益	6.4.7.17	135,697,931.98	135,849,048.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,751,914,298.98	-2,393,753,292.00

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	721,509.69	-85,771.39
减：二、费用		53,663,607.83	50,169,923.45
1.管理人报酬		40,908,531.91	38,190,849.40
2.托管费		8,181,706.33	7,638,169.88
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	1,998,524.57	1,928,850.14
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	2,574,845.02	2,412,054.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,864,149,617.84	-2,543,734,628.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,864,149,617.84	-2,543,734,628.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	11,181,188,994.97	4,963,727,153.90	16,144,916,148.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,864,149,617.84	1,864,149,617.84
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）	-527,696,927.65	-277,842,817.53	-805,539,745.18
其中：1.基金申购款	19,788,634.80	9,854,256.77	29,642,891.57
2.基金赎回款	-547,485,562.45	-287,697,074.30	-835,182,636.75
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）	10,653,492,067.32	6,550,033,954.21	17,203,526,021.53
项目	上年度可比期间 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	11,361,485,445.12	6,586,161,598.27	17,947,647,043.39

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,543,734,628.35	-2,543,734,628.35
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)	263,848,463.98	82,667,668.39	346,516,132.37
其中：1.基金申购款	543,088,088.18	177,858,129.92	720,946,218.10
2.基金赎回款	-279,239,624.20	-95,190,461.53	-374,430,085.73
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)	11,625,333,909.10	4,125,094,638.31	15,750,428,547.41

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：汪贵华，会计机构负责人：汪贵华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（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]1653 号《关于核准华夏沪深 300 交易型开放式指数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》、《华夏沪深 300 交易型开放式指数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 2012 年 12 月 17 日至 2012 年 12 月 19 日期间共募集 602,764,295.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（12）第 0075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 602,808,845 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,550 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。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。

根据《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2013 年 1 月 9 日为基金份额折算日。折算后的基金份额净值与 2013 年 1 月 9 日沪深 300 指数收盘值的千分之一基本一致。折算前基金份额总额为 16,020,609,566 份，本次基金份额折算比例为 0.40932601，折算后基金份额总额为 6,557,649,828 份。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》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、债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。
- 3、存款利息收入不征收增值税。
- 4、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- 5、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 6、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 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，暂免征收个人所得税。
- 7、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。
- 8、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 2017 年 6 月 30 日	
	活期存款	230,349,200.29
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	230,349,200.29	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,256,944,046.25	16,693,907,587.19	1,436,963,540.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,369,218.20	536,218.20
	银行间市场	-	-
	合计	6,369,218.20	536,218.20

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	15,262,777,046.25	16,700,276,805.39	1,437,499,759.14

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	413,911,200.00	-	-	-
其中：股指期货	413,911,200.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	413,911,200.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1709	沪深 300 股指期货 IF1709 合约	380.00	413,911,200.00	22,943,516.84	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					22,943,516.84
股指期货投资本期收益					78,454,443.16
股指期货投资本期公允价值变动					50,174,696.84

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场买入返售金融资产	160,000,000.00	-
合计	160,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	16,467.54
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	106,760.52
应收债券利息	10,264.06
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	159.40
合计	133,651.52

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	953,902.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	953,902.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应退替代款	166,897.84
可退替代款	223,696.29
预提费用	119,012.93
应付指数使用费	1,229,107.46
合计	1,738,714.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,576,749,828.00	11,181,188,994.97
本期申购	8,100,000.00	19,788,634.80
本期赎回（以“-”号填列）	-224,100,000.00	-547,485,562.45
本期末	4,360,749,828.00	10,653,492,067.32

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	11,382,797,409.14	-6,419,070,255.24	4,963,727,153.90
本期利润	112,235,318.86	1,751,914,298.98	1,864,149,617.84
本期基金份额交易产生的变动数	-539,752,239.07	261,909,421.54	-277,842,817.53
其中：基金申购款	20,205,837.45	-10,351,580.68	9,854,256.77
基金赎回款	-559,958,076.52	272,261,002.22	-287,697,074.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,955,280,488.93	-4,405,246,534.72	6,550,033,954.21

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,433,255.48
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	5,286,291.17
其他	1,965.59
合计	6,721,512.24

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-76,062,605.23
股票投资收益——赎回差价收入	18,947,066.69
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-57,115,538.54

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出股票成交总额	1,015,515,953.21
减：卖出股票成本总额	1,091,578,558.44
买卖股票差价收入	-76,062,605.23

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	835,182,636.75
减：现金支付赎回款总额	263,861,531.75
减：赎回股票成本总额	552,374,038.31
赎回差价收入	18,947,066.69

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	19,480,386.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,913,000.00
减：应收利息总额	1,658.13
买卖债券差价收入	565,728.67

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

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

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	78,454,443.16
合计	78,454,443.16

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	135,697,931.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	135,697,931.98

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	1,701,739,602.14
——股票投资	1,701,844,367.44
——债券投资	-104,765.30
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	50,174,696.84
——权证投资	-
——期货投资	50,174,696.84
4.其他	-
合计	1,751,914,298.98

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	721,509.69
合计	721,509.69

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,998,524.57
银行间市场交易费用	-
合计	1,998,524.57

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	39,671.58
银行费用	1,320.22
上市费	29,752.78
指数使用费	2,454,511.87
合计	2,574,845.02

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人股东控股的公司
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏沪深 300ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	40,908,531.91	38,190,849.40

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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,181,706.33	7,638,169.88

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

无。

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

无。

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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	934,768.00	0.02%	300.00	0.00%
华夏沪深 300ETF 联接	2,510,482,122.00	57.57%	2,734,074,422.00	59.74%

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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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
中国工商银行活期存款	230,349,200.29	1,433,255.48	463,804,662.54	1,468,360.21

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

金额单位：人民币元

本期					
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券股份有限公司	113011	光大转债	老股东优先配售	189,130.00	18,913,000.00
上年度可比期间					
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券股份有限公司	110032	三一转债	老股东优先配售	37,820	3,782,000.00
中信证券股	600489	中金黄金	老股东配	449,393	2,795,224.46

份有限公司			售		
中信证券股 份有限公司	113009	广汽转债	老股东优 先配售	9,150	915,000.00

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 7,023,079,260.00 元（上年度可比期间：7,262,706,420.00 元），支付给中信期货的佣金为 231,762.12 元（上年度可比期间：239,669.76 元）。

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（2017 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新发流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新发流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新发流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾	2017-06-23	2017-07-03	新发	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

	股份			流通受限						
--	----	--	--	------	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	12,907,300	69,594,242.86	96,417,531.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项	6.21	-	-	14,606,410	133,957,795.76	90,705,806.10	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	3,139,883	57,760,106.05	69,987,992.07	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大事项	3.60	-	-	18,715,785	72,048,405.91	67,376,826.00	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大事项	30.68	-	-	1,701,354	98,076,786.52	52,197,540.72	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	11,973,179	47,069,682.14	41,068,003.97	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项	14.12	-	-	2,771,326	35,348,281.67	39,131,123.12	-
601727	上海电气	2017-06-22	重大事项	7.57	2017-07-03	7.54	5,030,016	56,102,612.87	38,077,221.12	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	-	-	2,219,869	56,149,502.20	32,387,888.71	-
601919	中远海控	2017-05-17	重大事项	5.35	2017-07-26	5.89	6,008,727	61,023,297.46	32,146,689.45	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24	-	-	1,581,458	25,000,100.85	32,008,709.92	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大事项	24.93	-	-	1,150,867	33,372,400.01	28,691,114.31	-
600959	江苏有线	2017-06-19	重大事项	10.57	-	-	2,473,767	32,369,720.70	26,147,717.19	-
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项	7.68	-	-	2,744,000	26,210,391.56	21,073,920.00	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项	17.40	-	-	1,141,860	22,153,110.72	19,868,364.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	2,344,861	28,546,815.37	19,392,000.47	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大事项	30.82	2017-07-17	27.74	584,600	19,930,278.55	18,017,372.00	-
601872	招商轮船	2017-05-02	重大事项	5.16	-	-	3,291,000	23,222,572.57	16,981,560.00	-

600654	*ST 中安	2017-06-07	重大事 项	13.48	-	-	1,169,900	22,310,512.16	15,770,252.00	-
601608	中信 重工	2017-04-19	重大事 项	5.54	2017-07-26	5.26	2,026,568	14,504,267.01	11,227,186.72	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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，参考压力测试结果，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敏感性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敏感性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 2017年6月30日		上年度末 2016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	16,693,907,587.19	97.04	14,746,925,352.88	91.34
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	16,693,907,587.19	97.04	14,746,925,352.88	91.34

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沪深 300 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、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。	
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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	+5%	840,621,716.55	833,400,571.60
	-5%	-840,621,716.55	-833,400,571.60

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 2017 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 16,700,276,805.39 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2016 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 14,753,399,336.38 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。

6.4.14.5 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§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	16,693,907,587.19	96.07
	其中：股票	16,693,907,587.19	96.07
2	固定收益投资	6,369,218.20	0.04
	其中：债券	6,369,218.20	0.04
	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	160,000,000.00	0.92
	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	431,440,476.47	2.48
7	其他各项资产	84,965,468.27	0.49
8	合计	17,376,682,750.13	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 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	40,100,962.68	0.23
B	采矿业	536,496,310.69	3.12
C	制造业	6,000,102,057.17	34.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	452,541,500.30	2.63
E	建筑业	773,421,557.07	4.50
F	批发和零售业	360,173,572.44	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	485,924,720.08	2.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	857,202,656.05	4.98
J	金融业	5,739,431,362.47	33.36
K	房地产业	889,912,061.05	5.17
L	租赁和商务服务业	146,318,588.68	0.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	138,013,866.96	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	32,999,992.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	192,430,043.80	1.12
S	综合	48,838,327.75	0.28
	合计	16,693,907,579.19	97.04

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	17,367,594	861,606,338.34	5.01
2	600036	招商银行	16,535,414	395,361,748.74	2.30
3	600519	贵州茅台	804,960	379,820,376.00	2.21
4	601166	兴业银行	19,982,800	336,910,008.00	1.96
5	000651	格力电器	7,715,830	317,660,721.10	1.85
6	000333	美的集团	7,256,377	312,314,466.08	1.82
7	600016	民生银行	37,902,608	311,559,437.76	1.81
8	000002	万科 A	10,914,820	272,543,055.40	1.58
9	601328	交通银行	44,049,301	271,343,694.16	1.58
10	601668	中国建筑	24,045,067	232,756,248.56	1.35
11	600000	浦发银行	18,021,781	227,975,529.65	1.33
12	601288	农业银行	61,285,725	215,725,752.00	1.25
13	600030	中信证券	12,619,400	214,782,188.00	1.25

14	600887	伊利股份	9,746,692	210,431,080.28	1.22
15	600837	海通证券	12,973,564	192,657,425.40	1.12
16	002415	海康威视	5,920,267	191,224,624.10	1.11
17	601398	工商银行	34,579,938	181,544,674.50	1.06
18	601169	北京银行	19,503,098	178,843,408.66	1.04
19	600104	上汽集团	5,618,830	174,464,671.50	1.01
20	601601	中国太保	5,038,550	170,655,688.50	0.99
21	000858	五 粮 液	3,044,175	169,438,780.50	0.98
22	600900	长江电力	10,581,403	162,741,978.14	0.95
23	000725	京东方 A	38,102,400	158,505,984.00	0.92
24	601766	中国中车	15,600,783	157,879,923.96	0.92
25	601211	国泰君安	7,230,120	148,289,761.20	0.86
26	600276	恒瑞医药	2,709,021	137,049,372.39	0.80
27	000001	平安银行	13,763,426	129,238,570.14	0.75
28	601988	中国银行	33,790,052	125,023,192.40	0.73
29	600048	保利地产	11,406,644	113,724,240.68	0.66
30	601390	中国中铁	11,951,526	103,619,730.42	0.60
31	600518	康美药业	4,758,289	103,445,202.86	0.60
32	601818	光大银行	25,530,482	103,398,452.10	0.60
33	600028	中国石化	16,852,377	99,934,595.61	0.58
34	600050	中国联通	12,907,300	96,417,531.00	0.56
35	600019	宝钢股份	14,174,897	95,113,558.87	0.55
36	600015	华夏银行	10,278,662	94,769,263.64	0.55
37	601688	华泰证券	5,236,298	93,729,734.20	0.54
38	601989	中国重工	14,606,410	90,705,806.10	0.53
39	000063	中兴通讯	3,814,229	90,549,796.46	0.53
40	002450	康得新	3,962,490	89,235,274.80	0.52
41	601186	中国铁建	7,377,486	88,751,156.58	0.52
42	002304	洋河股份	966,654	83,915,233.74	0.49
43	000776	广发证券	4,744,740	81,846,765.00	0.48
44	001979	招商蛇口	3,801,461	81,199,206.96	0.47
45	601006	大秦铁路	9,533,700	79,987,743.00	0.46
46	000538	云南白药	834,458	78,313,883.30	0.46
47	600703	三安光电	3,923,531	77,293,560.70	0.45
48	600690	青岛海尔	4,888,344	73,569,577.20	0.43
49	600585	海螺水泥	3,205,618	72,863,697.14	0.42
50	601628	中国人寿	2,669,881	72,033,389.38	0.42
51	601088	中国神华	3,139,883	69,987,992.07	0.41
52	600958	东方证券	4,991,200	69,427,592.00	0.40
53	601336	新华保险	1,336,941	68,718,767.40	0.40
54	600795	国电电力	18,715,785	67,376,826.00	0.39
55	002024	苏宁云商	5,970,115	67,163,793.75	0.39
56	601939	建设银行	10,766,315	66,212,837.25	0.38

57	601901	方正证券	6,598,443	65,522,538.99	0.38
58	601009	南京银行	5,828,428	65,336,677.88	0.38
59	600340	华夏幸福	1,894,838	63,628,660.04	0.37
60	600999	招商证券	3,666,882	63,143,708.04	0.37
61	600309	万华化学	2,190,748	62,743,022.72	0.36
62	002230	科大讯飞	1,559,248	62,213,995.20	0.36
63	600089	特变电工	6,001,281	61,993,232.73	0.36
64	600741	华域汽车	2,527,774	61,273,241.76	0.36
65	002142	宁波银行	3,125,917	60,330,198.10	0.35
66	000423	东阿阿胶	838,379	60,271,066.31	0.35
67	601857	中国石油	7,788,212	59,891,350.28	0.35
68	600660	福耀玻璃	2,247,231	58,517,895.24	0.34
69	601985	中国核电	7,486,163	58,466,933.03	0.34
70	601669	中国电建	7,358,800	58,281,696.00	0.34
71	600009	上海机场	1,545,095	57,647,494.45	0.34
72	601899	紫金矿业	16,636,300	57,062,509.00	0.33
73	000568	泸州老窖	1,124,748	56,889,753.84	0.33
74	002241	歌尔股份	2,943,064	56,742,273.92	0.33
75	300070	碧水源	3,014,970	56,229,190.50	0.33
76	601377	兴业证券	7,515,209	55,838,002.87	0.32
77	002456	欧菲光	3,048,415	55,389,700.55	0.32
78	000166	申万宏源	9,646,777	54,021,951.20	0.31
79	601607	上海医药	1,849,500	53,413,560.00	0.31
80	300072	三聚环保	1,437,650	53,264,932.50	0.31
81	002236	大华股份	2,323,879	53,007,679.99	0.31
82	000069	华侨城 A	5,262,145	52,937,178.70	0.31
83	002736	国信证券	3,944,356	52,262,717.00	0.30
84	300104	乐视网	1,701,354	52,197,540.72	0.30
85	002466	天齐锂业	956,800	52,002,080.00	0.30
86	600886	国投电力	6,526,980	51,563,142.00	0.30
87	000338	潍柴动力	3,882,724	51,251,956.80	0.30
88	000783	长江证券	5,319,212	50,372,937.64	0.29
89	600196	复星医药	1,612,877	49,983,058.23	0.29
90	600031	三一重工	6,138,300	49,904,379.00	0.29
91	600068	葛洲坝	4,429,945	49,792,581.80	0.29
92	300059	东方财富	4,124,700	49,578,894.00	0.29
93	600029	南方航空	5,628,944	48,971,812.80	0.28
94	600010	包钢股份	21,925,425	48,016,680.75	0.28
95	601600	中国铝业	10,542,646	47,652,759.92	0.28
96	002008	大族激光	1,368,590	47,407,957.60	0.28
97	601888	中国国旅	1,565,614	47,187,605.96	0.27
98	600066	宇通客车	2,130,315	46,803,020.55	0.27
99	601788	光大证券	3,130,700	46,741,351.00	0.27

100	600637	东方明珠	2,118,237	45,902,195.79	0.27
101	600606	绿地控股	5,852,900	45,769,678.00	0.27
102	000625	长安汽车	3,127,100	45,092,782.00	0.26
103	000839	中信国安	4,399,350	43,949,506.50	0.26
104	601099	太平洋	10,927,678	43,929,265.56	0.26
105	002594	比亚迪	871,730	43,542,913.50	0.25
106	601933	永辉超市	6,137,060	43,450,384.80	0.25
107	601555	东吴证券	3,847,772	43,210,479.56	0.25
108	600535	天士力	1,039,640	43,186,645.60	0.25
109	601618	中国中冶	8,586,300	43,017,363.00	0.25
110	600893	航发动力	1,562,656	42,660,508.80	0.25
111	000413	东旭光电	3,760,000	42,187,200.00	0.25
112	600383	金地集团	3,618,375	41,502,761.25	0.24
113	600522	中天科技	3,441,300	41,467,665.00	0.24
114	600406	国电南瑞	2,336,240	41,234,636.00	0.24
115	000100	TCL 集团	11,973,179	41,068,003.97	0.24
116	300124	汇川技术	1,602,424	40,925,908.96	0.24
117	000768	中航飞机	2,219,108	40,920,351.52	0.24
118	600705	中航资本	7,195,546	40,654,834.90	0.24
119	002673	西部证券	2,806,870	39,913,691.40	0.23
120	600109	国金证券	3,394,311	39,781,324.92	0.23
121	002475	立讯精密	1,359,230	39,743,885.20	0.23
122	600816	安信信托	2,922,914	39,722,401.26	0.23
123	600111	北方稀土	3,495,351	39,602,326.83	0.23
124	600100	同方股份	2,771,326	39,131,123.12	0.23
125	601800	中国交建	2,448,557	38,907,570.73	0.23
126	002202	金风科技	2,509,228	38,817,757.16	0.23
127	000963	华东医药	778,740	38,703,378.00	0.22
128	002739	万达电影	752,228	38,341,061.16	0.22
129	601727	上海电气	5,030,016	38,077,221.12	0.22
130	000895	双汇发展	1,587,624	37,706,070.00	0.22
131	600271	航天信息	1,791,374	36,973,959.36	0.21
132	600570	恒生电子	791,674	36,955,342.32	0.21
133	601018	宁波港	6,336,100	35,798,965.00	0.21
134	600023	浙能电力	6,541,750	35,717,955.00	0.21
135	600739	辽宁成大	1,946,283	35,091,482.49	0.20
136	600177	雅戈尔	3,445,532	34,868,783.84	0.20
137	600352	浙江龙盛	3,651,280	34,796,698.40	0.20
138	600674	川投能源	3,529,530	34,659,984.60	0.20
139	000728	国元证券	2,834,441	34,636,869.02	0.20
140	601992	金隅股份	5,348,000	34,601,560.00	0.20
141	600547	山东黄金	1,191,414	34,467,607.02	0.20
142	000623	吉林敖东	1,491,899	34,149,568.11	0.20

143	300024	机器人	1,750,707	34,138,786.50	0.20
144	601225	陕西煤业	4,809,700	34,004,579.00	0.20
145	600221	海航控股	10,540,100	33,939,122.00	0.20
146	002508	老板电器	759,907	33,040,756.36	0.19
147	002044	美年健康	1,941,176	32,999,992.00	0.19
148	600018	上港集团	5,201,075	32,974,815.50	0.19
149	002065	东华软件	1,510,774	32,919,765.46	0.19
150	000793	华闻传媒	3,233,794	32,725,995.28	0.19
151	002007	华兰生物	894,530	32,650,345.00	0.19
152	600485	信威集团	2,219,869	32,387,888.71	0.19
153	600804	鹏博士	1,813,227	32,184,779.25	0.19
154	601919	中远海控	6,008,727	32,146,689.45	0.19
155	600115	东方航空	4,717,200	32,076,960.00	0.19
156	002252	上海莱士	1,581,458	32,008,709.92	0.19
157	000157	中联重科	7,042,570	31,621,139.30	0.18
158	600415	小商品城	4,363,504	31,591,768.96	0.18
159	603993	洛阳钼业	6,230,337	31,525,505.22	0.18
160	000540	中天金融	4,518,350	31,402,532.50	0.18
161	601111	中国国航	3,193,678	31,138,360.50	0.18
162	600208	新潮中宝	6,893,453	31,020,538.50	0.18
163	601998	中信银行	4,913,978	30,908,921.62	0.18
164	600085	同仁堂	879,200	30,736,832.00	0.18
165	600820	隧道股份	3,025,008	30,552,580.80	0.18
166	601198	东兴证券	1,768,000	30,480,320.00	0.18
167	002465	海格通信	2,751,569	29,551,851.06	0.17
168	600436	片仔癀	483,622	29,520,286.88	0.17
169	600153	建发股份	2,272,205	29,379,610.65	0.17
170	000826	启迪桑德	821,398	28,847,497.76	0.17
171	000630	铜陵有色	10,124,855	28,754,588.20	0.17
172	002310	东方园林	1,716,587	28,701,334.64	0.17
173	000503	海虹控股	1,150,867	28,691,114.31	0.17
174	000709	河钢股份	6,810,000	28,533,900.00	0.17
175	600157	永泰能源	7,968,325	28,446,920.25	0.17
176	600362	江西铜业	1,663,969	28,054,517.34	0.16
177	300017	网宿科技	2,314,532	27,936,401.24	0.16
178	002081	金螳螂	2,543,310	27,925,543.80	0.16
179	000009	中国宝安	3,446,975	27,886,027.75	0.16
180	000060	中金岭南	2,483,512	27,815,334.40	0.16
181	600663	陆家嘴	1,175,663	27,792,673.32	0.16
182	000876	新希望	3,380,450	27,787,299.00	0.16
183	600489	中金黄金	2,766,022	27,743,200.66	0.16
184	600061	国投安信	1,776,220	27,620,221.00	0.16
185	002146	荣盛发展	2,788,092	27,518,468.04	0.16

186	600170	上海建工	7,137,675	27,265,918.50	0.16
187	601229	上海银行	1,059,300	27,054,522.00	0.16
188	002027	分众传媒	1,961,576	26,991,285.76	0.16
189	601155	新城控股	1,448,400	26,853,336.00	0.16
190	002074	国轩高科	843,900	26,625,045.00	0.15
191	601216	君正集团	5,410,866	26,459,134.74	0.15
192	600118	中国卫星	947,891	26,389,285.44	0.15
193	600332	白云山	901,370	26,175,784.80	0.15
194	600959	江苏有线	2,473,767	26,147,717.19	0.15
195	002500	山西证券	2,720,444	26,061,853.52	0.15
196	600682	南京新百	706,000	26,051,400.00	0.15
197	000750	国海证券	4,731,655	26,024,102.50	0.15
198	600297	广汇汽车	3,439,540	25,899,736.20	0.15
199	601633	长城汽车	1,932,812	25,687,071.48	0.15
200	600008	首创股份	3,864,388	25,427,673.04	0.15
201	600369	西南证券	4,526,058	25,391,185.38	0.15
202	000425	徐工机械	6,742,012	25,282,545.00	0.15
203	600150	中国船舶	1,105,313	25,278,508.31	0.15
204	300315	掌趣科技	3,078,538	25,120,870.08	0.15
205	601333	广深铁路	5,437,058	24,575,502.16	0.14
206	300144	宋城演艺	1,164,808	24,309,542.96	0.14
207	000559	万向钱潮	2,206,814	23,436,364.68	0.14
208	000792	盐湖股份	2,233,164	23,336,563.80	0.14
209	600688	上海石化	3,513,266	23,222,688.26	0.13
210	000686	东北证券	2,251,256	22,625,122.80	0.13
211	002195	二三四五	3,161,390	22,603,938.50	0.13
212	000402	金融街	1,916,812	22,465,036.64	0.13
213	000983	西山煤电	2,526,560	22,157,931.20	0.13
214	600583	海油工程	3,544,400	22,117,056.00	0.13
215	601117	中国化学	3,163,400	22,112,166.00	0.13
216	600718	东软集团	1,394,957	21,691,581.35	0.13
217	300027	华谊兄弟	2,678,786	21,671,378.74	0.13
218	300033	同花顺	344,333	21,420,955.93	0.12
219	600649	城投控股	2,028,188	21,316,255.88	0.12
220	002411	必康股份	736,381	21,296,138.52	0.12
221	600498	烽火通信	838,176	21,247,761.60	0.12
222	002426	胜利精密	2,744,000	21,073,920.00	0.12
223	600895	张江高科	1,241,250	20,952,300.00	0.12
224	600827	百联股份	1,285,551	20,890,203.75	0.12
225	600256	广汇能源	5,022,985	20,795,157.90	0.12
226	600373	中文传媒	883,311	20,766,641.61	0.12
227	002385	大北农	3,287,509	20,678,431.61	0.12
228	000917	电广传媒	1,818,087	20,544,383.10	0.12

229	002183	怡亚通	2,378,000	20,522,140.00	0.12
230	600704	物产中大	2,761,320	20,130,022.80	0.12
231	600588	用友网络	1,174,272	20,103,536.64	0.12
232	600074	保千里	1,563,900	20,033,559.00	0.12
233	000415	渤海金控	2,975,600	20,025,788.00	0.12
234	600666	奥瑞德	1,141,860	19,868,364.00	0.12
235	000008	神州高铁	2,702,030	19,670,778.40	0.11
236	002129	中环股份	2,344,861	19,392,000.47	0.11
237	600060	海信电器	1,257,937	19,082,904.29	0.11
238	002470	金正大	2,517,408	18,956,082.24	0.11
239	600376	首开股份	1,655,100	18,934,344.00	0.11
240	600919	江苏银行	2,036,400	18,918,156.00	0.11
241	601718	际华集团	2,112,336	18,567,433.44	0.11
242	601866	中远海发	5,086,600	18,311,760.00	0.11
243	002049	紫光国芯	584,600	18,017,372.00	0.10
244	002558	巨人网络	388,977	17,978,516.94	0.10
245	002602	世纪华通	494,170	17,918,604.20	0.10
246	002352	顺丰控股	334,800	17,797,968.00	0.10
247	000959	首钢股份	2,545,146	17,790,570.54	0.10
248	600909	华安证券	1,741,000	17,566,690.00	0.10
249	002174	游族网络	552,756	17,555,530.56	0.10
250	601997	贵阳银行	1,106,200	17,489,022.00	0.10
251	600038	中直股份	377,629	17,284,079.33	0.10
252	002555	三七互娱	669,225	17,112,083.25	0.10
253	601872	招商轮船	3,291,000	16,981,560.00	0.10
254	600977	中国电影	897,700	16,804,944.00	0.10
255	000977	浪潮信息	961,213	16,648,209.16	0.10
256	600021	上海电力	1,371,961	16,587,008.49	0.10
257	000627	天茂集团	2,049,100	16,556,728.00	0.10
258	300168	万达信息	1,127,400	16,403,670.00	0.10
259	600037	歌华有线	1,116,339	16,253,895.84	0.09
260	002152	广电运通	1,946,275	16,173,545.25	0.09
261	600654	*ST 中安	1,169,900	15,770,252.00	0.09
262	600737	中粮糖业	1,645,700	15,535,408.00	0.09
263	002714	牧原股份	557,600	15,177,872.00	0.09
264	000671	阳光城	2,597,400	15,116,868.00	0.09
265	600549	厦门钨业	694,530	14,925,449.70	0.09
266	002131	利欧股份	4,496,100	14,792,169.00	0.09
267	600372	中航电子	845,664	14,689,183.68	0.09
268	600685	中船防务	526,975	14,428,575.50	0.08
269	000738	航发控制	733,751	14,359,507.07	0.08
270	000938	紫光股份	234,900	14,357,088.00	0.08
271	601118	海南橡胶	2,521,526	14,322,267.68	0.08

272	000718	苏宁环球	2,432,700	14,255,622.00	0.08
273	002292	奥飞娱乐	838,267	14,166,712.30	0.08
274	600482	中国动力	558,000	14,111,820.00	0.08
275	600446	金证股份	802,541	14,108,670.78	0.08
276	601877	正泰电器	685,265	13,766,973.85	0.08
277	000156	华数传媒	918,995	13,702,215.45	0.08
278	601021	春秋航空	384,700	12,937,461.00	0.08
279	601375	中原证券	1,285,300	12,930,118.00	0.08
280	002424	贵州百灵	678,921	12,804,450.06	0.07
281	300133	华策影视	1,120,803	12,552,993.60	0.07
282	601881	中国银河	1,033,800	12,260,868.00	0.07
283	002153	石基信息	513,276	11,666,763.48	0.07
284	000961	中南建设	1,783,700	11,629,724.00	0.07
285	300251	光线传媒	1,410,900	11,555,271.00	0.07
286	601608	中信重工	2,026,568	11,227,186.72	0.07
287	601958	金钼股份	1,552,400	11,130,708.00	0.06
288	600233	圆通速递	543,058	10,638,506.22	0.06
289	002299	圣农发展	712,900	10,600,823.00	0.06
290	601163	三角轮胎	384,400	10,109,720.00	0.06
291	601611	中国核建	841,200	10,069,164.00	0.06
292	600871	石化油服	2,896,100	9,672,974.00	0.06
293	600926	杭州银行	646,920	9,606,762.00	0.06
294	603858	步长制药	120,746	8,650,243.44	0.05
295	601966	玲珑轮胎	384,400	8,622,092.00	0.05
296	603160	汇顶科技	78,800	7,903,640.00	0.05
297	000555	神州信息	463,400	7,738,780.00	0.04
298	600188	兖州煤业	617,502	7,558,224.48	0.04
299	002797	第一创业	618,240	5,693,990.40	0.03
300	601127	小康股份	285,400	5,693,730.00	0.03
301	002841	视源股份	71,480	5,305,245.60	0.03
302	002831	裕同科技	70,600	5,295,000.00	0.03
303	002839	张家港行	316,900	4,981,668.00	0.03
304	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.00
305	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
306	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
307	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
308	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
309	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
310	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
311	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
312	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
313	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
314	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00

315	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
316	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
317	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
318	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
319	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
320	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
321	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
322	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
323	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	002415	海康威视	49,535,606.34	0.31
2	601318	中国平安	46,658,057.59	0.29
3	600522	中天科技	39,302,638.40	0.24
4	601992	金隅股份	36,178,600.00	0.22
5	600000	浦发银行	34,966,819.80	0.22
6	002456	欧菲光	34,084,347.38	0.21
7	002508	老板电器	33,227,587.79	0.21
8	002044	美年健康	29,854,598.15	0.18
9	600436	片仔癀	26,691,018.46	0.17
10	601229	上海银行	26,103,159.48	0.16
11	600682	南京新百	25,996,846.44	0.16
12	600519	贵州茅台	23,235,326.78	0.14
13	600036	招商银行	21,827,234.49	0.14
14	601117	中国化学	20,652,103.03	0.13
15	601166	兴业银行	20,524,816.66	0.13
16	002411	必康股份	19,926,090.30	0.12
17	600016	民生银行	19,800,051.00	0.12
18	600340	华夏幸福	19,324,700.00	0.12
19	600919	江苏银行	19,178,813.00	0.12
20	600104	上汽集团	18,777,245.72	0.12

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	002456	欧菲光	33,711,998.65	0.21

2	600867	通化东宝	32,110,583.70	0.20
3	002085	万丰奥威	27,809,685.80	0.17
4	601166	兴业银行	25,494,241.66	0.16
5	000778	新兴铸管	25,213,411.84	0.16
6	600000	浦发银行	24,014,929.49	0.15
7	601258	庞大集团	22,247,269.92	0.14
8	300015	爱尔眼科	21,892,835.04	0.14
9	000039	中集集团	20,751,610.98	0.13
10	600839	四川长虹	20,173,776.34	0.12
11	300002	神州泰岳	19,317,332.29	0.12
12	300058	蓝色光标	18,544,998.57	0.11
13	600875	东方电气	17,935,140.96	0.11
14	600252	中恒集团	17,881,340.49	0.11
15	300182	捷成股份	16,830,185.78	0.10
16	000651	格力电器	16,809,288.33	0.10
17	600873	梅花生物	16,600,774.42	0.10
18	000333	美的集团	15,736,028.67	0.10
19	601200	上海环境	14,232,543.31	0.09
20	300146	汤臣倍健	14,231,738.07	0.09

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	1,862,943,753.29
卖出股票的收入（成交）总额	1,015,515,953.21

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	6,369,218.20	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	6,369,218.20	0.04
----	----	--------------	------

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	123001	蓝标转债	23,590	2,472,467.90	0.01
2	110031	航信转债	20,470	2,117,416.80	0.01
3	113009	广汽转债	9,150	1,131,397.50	0.01
4	110034	九州转债	5,120	647,936.00	0.00
5	-	-	-	-	-

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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1709	沪深 300 股指期货 IF1709 合约	380.00	413,911,200.00	22,943,516.84	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					22,943,516.84
股指期货投资本期收益					78,454,443.16
股指期货投资本期公允价值变动					50,174,696.84

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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	83,136,604.56
2	应收证券清算款	1,695,212.19
3	应收股利	-
4	应收利息	133,651.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,965,468.27

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	123001	蓝标转债	2,472,467.90	0.01
2	110031	航信转债	2,117,416.80	0.01
3	113009	广汽转债	1,131,397.50	0.01
4	110034	九州转债	647,936.00	0.00

7.12.5 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		华夏沪深 300ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,827	1,542,536.20	1,812,031,709.00	41.55%	38,235,997.00	0.88%	2,510,482,122.00	57.57%

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	中央汇金投资有限责任公司	1,790,942,652.00	41.07%
2	新韩法国巴黎资产运用株式会社—新韩法巴中国内地指数 RQFII 股票集成投资信托基金	3,983,058.00	0.09%
3	联讯证券股份有限公司	3,699,935.00	0.08%
4	李成玉	3,043,900.00	0.07%
5	复华证券投资信托股份有限公司—客户资金	1,536,000.00	0.04%
6	国信证券股份有限公司	1,420,000.00	0.03%
7	吕俐	1,368,300.00	0.03%
8	沙天韵	1,240,000.00	0.03%
9	长江证券—建行—长江证券超越理财核心成长集合资产管理计划	1,133,000.00	0.03%
10	黄巧君	1,114,000.00	0.03%
11	中国工商银行股份有限公司—华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,510,482,122.00	57.57%

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、基金投资和研发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（2012 年 12 月 25 日）基金份额总额	602,808,845
本报告期期初基金份额总额	4,576,749,828
本报告期基金总申购份额	8,100,000
减：本报告期基金总赎回份额	224,100,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,360,749,828

§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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	1	1,582,531,627.69	56.73%	207,811.90	56.73%	-
中银国际证券	1	948,837,875.16	34.01%	124,599.29	34.01%	-
国金证券	3	258,168,610.11	9.25%	33,899.44	9.25%	-

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，本基金还选择了信达证券、中国银河证券、中信建投证券、上海证券、中投证券、中泰证券、新时代证券、东北证券、天风证券、兴业证券、中金公司、中信证券和长江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、中金公司和天风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
国泰君安证券	19,480,386.80	100.00%	4,941,000,000.00	100.00%
中银国际证券	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-

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旗下基金认购关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-20
2	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-19
3	华夏基金管理有限公司关于青岛分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-03

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-01-01 至 2017-06-30	1,790,942,652.00	-	-	1,790,942,652.00	41.07%
华夏沪深 300ETF 联接	1	2017-01-01 至 2017-06-30	2,734,074,422.00	27,800.00	223,620,100.00	2,510,482,122.00	57.57%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于5000万元，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

12.1.2 《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

12.1.4 法律意见书;

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇一七年八月二十六日