

**华夏沪深 300 交易型开放式指数
证券投资基金
2018 年半年度报告
2018 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：二〇一八年八月二十五日

§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 2018 年 8 月 23 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 2018 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.....	10
§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.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 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.....	39
7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	39
7.7 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.....	39
7.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.10 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§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	4,605,549,828 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	010-66105798
	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	010-66105799
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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,406,156.14
本期利润	-2,313,996,616.86
加权平均基金份额本期利润	-0.5351
本期加权平均净值利润率	-12.52%
本期基金份额净值增长率	-12.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	6,386,913,482.12
期末可供分配基金份额利润	1.3868
期末基金资产净值	17,638,462,067.35
期末基金份额净值	3.8298
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	62.08%

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	-6.94%	1.29%	-7.66%	1.28%	0.72%	0.01%
过去三个月	-9.12%	1.13%	-9.94%	1.14%	0.82%	-0.01%
过去六个月	-12.23%	1.15%	-12.90%	1.16%	0.67%	-0.01%

过去一年	-2.92%	0.95%	-4.25%	0.95%	1.33%	0.00%
过去三年	-15.30%	1.49%	-21.51%	1.49%	6.21%	0.00%
自基金合同生效起至今	62.08%	1.51%	47.44%	1.51%	14.64%	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 2018 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,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、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中小板 ETF、华夏中证 500ETF、华夏创业板 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、华夏快线货币 ETF 和华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF 等，初步形成了覆盖宽基指数、行业指数、主题指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、A 股市场指数、海外市场指数、信用债指数等较为完整的产品线。

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《中国证券报》评奖活动中，公司荣获“中国基金业 20 周年卓越贡献公司”和“被动投资金牛基金公司”两大奖项，旗下华夏回报混合荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”称号，华夏安康债券荣获“2017 年度开放式债券型金牛基金”称号。在《证券时报》评奖活动中，旗下华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。在《上海证券报》举行的 2018 中国基金业峰会暨第十五届“金基金”颁奖评选中，华夏基金荣获公募基金 20 周年“金基金”TOP 基金公司大奖、华夏沪深 300ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（一年期）、华夏上证 50ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（三年期）。在《证券时报》的评奖活动中，华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。

在客户服务方面，2018 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）华夏基金电子交易平台开展华夏财富宝货币 A、华夏薪金宝货币转换业务优惠活动，为客户提供了更便捷和优惠的基金投资方式；（2）微信服务号上线随存随取业务实时通知功能，方便客户及时了解交易变动的情况；华夏基金网上交易平台上线手机号码登录功能，为客户登录网上交易平台提供了更便捷的方式；（3）与中原银行、长城华西银行、西安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“四大明星基金有奖寻人”、“华夏基金 20 周年司庆感恩二十年”、“华夏基金 20 周年献礼，华夏基金户口本”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	说明
		任职日期	离		

			任 日 期	年 限	
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2012-12-25	-	18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）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012年8月9日至2017年11月10日期间）、MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年2月12日至2017年11月10日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年1月13日至2017年11月10日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012年8月21日至2017年11月10日期间）、MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年2月12日至2017年11月10日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014年12月23日至2017年11月10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	-	10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，本基金出现 2 次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，为本基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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，美国经济仍较为强劲，通胀率略有上升，失业率维持低位；欧元区制造业 PMI 持续走低，6 月降至今年来最低水平；日本经济继续温和复苏，经济形势相对稳定，但通胀水平依然较低；新兴市场经济体总体经济增长较快，但内部表现继续分化，部分经济体仍旧面临调整与转型压力。国内方面，供给侧结构性改革深入推进，实现了投资继续保持增长、投资结构不断改善的运行态势；消费品市场规模进一步扩大、商品结构持续优化，新业态和新商业模式快速发展，消费继续发挥经济增长第一驱动力的作用；出口增速总体保持稳定，进口超预期增长；整体而言，中国经济延续了总体平稳、稳中向好的发展态势。

市场方面，沪深 300 指数在报告期内总体呈现震荡下行的走势，年初因 2017 年经济数据超预期，指数快速上行，并在 1 月末触及上半年最高点；2 月，全球资本市场发生大幅调整，恐慌情绪蔓延至国内，指数开始迅速回落；3 月底以来，中美贸易摩擦持续发酵、资管新规落地、部分上市公司年报业绩爆雷、美联储加息节奏加快、地缘政治变局等诸多因素，令市场避险情绪再度升温，沪深 300 指数震荡下探；6 月底，沪深 300 指数市盈率为 11.9 倍，估值水平接近 2016 年年初低位。

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。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，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为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、平安证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、东方证券股份有限公司等。

目前该基金已被调入融资融券标的证券名单。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 3.8298 元, 本报告期份额净值增长率为-12.23%, 同期沪深 300 指数增长率为-12.90%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.67%, 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, 贸易战和国际金融环境变化的影响仍不确定, 但预计美国经济增长仍较为乐观, 美联储仍将加息, 缩表进程或将加快; 欧洲央行货币政策仍将保持耐心、持续和谨慎, 意大利经济情况不容乐观, 债务危机存在一定风险但目前看还较为可控。国内方面, 地产投资、基建投资大概率维持回落态势, 制造业将保持温和复苏, 同时结构性分化将加大, 高端制造业投资或将提速; 在扩大内需政策的带动下, 下半年或将释放一定内需空间, 消费增长逐步得到修复; 受制于中美贸易不确定性及我国提出扩大进口促进对外贸易平衡发展的意见, 预计下半年净出口对经济增长负面影响将加大。

市场方面, A 股整体估值水平已接近历史低位, 具有较高的安全边际, 而且绩优股的业绩确定性仍将在长期内产生显著的溢价, 沪深 300 等龙头指数仍将为市场所青睐。

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份投资和每一份信任, 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, 本基金管理人作为准确、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，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。

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 2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	31,619,059.57	18,009,104.33
结算备付金		78,374,547.99	157,518,878.18

存出保证金		51,350,993.02	42,201,974.48
交易性金融资产	6.4.7.2	17,220,733,920.51	18,411,742,931.07
其中：股票投资		17,220,733,920.51	18,402,578,531.07
基金投资		-	-
债券投资		-	9,164,400.00
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	280,000,000.00	80,000,000.00
应收证券清算款		95,665.91	4,402,972.69
应收利息	6.4.7.5	173,931.73	126,568.89
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		17,662,348,118.73	18,714,002,429.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		9,340,012.43	4,307,720.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,290,730.08	7,928,154.27
应付托管费		1,458,146.02	1,585,630.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	937,250.55	626,392.65
应交税费		25.21	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	4,859,887.09	1,521,729.42
负债合计		23,886,051.38	15,969,627.59
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	11,251,548,585.23	10,468,798,142.60
未分配利润	6.4.7.10	6,386,913,482.12	8,229,234,659.45
所有者权益合计		17,638,462,067.35	18,698,032,802.05
负债和所有者权益总计		17,662,348,118.73	18,714,002,429.64

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.82981 元，基金份额总额 4,605,549,828 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-2,254,079,019.73	1,917,813,225.67
1.利息收入		3,042,606.74	7,574,851.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,344,903.74	6,721,512.24
债券利息收入		10,687.84	17,783.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,687,015.16	835,556.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		58,356,852.57	157,602,565.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-118,710,608.93	-57,115,538.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,843,035.72	565,728.67
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	1,015,983.99	78,454,443.16
股利收益	6.4.7.17	174,208,441.79	135,697,931.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,315,402,773.00	1,751,914,298.98
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	-75,706.04	721,509.69
减：二、费用		59,917,597.13	53,663,607.83
1.管理人报酬		45,760,405.46	40,908,531.91
2.托管费		9,152,081.09	8,181,706.33
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	2,108,247.39	1,998,524.57
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		30,725.93	-
7.其他费用	6.4.7.21	2,866,137.26	2,574,845.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,313,996,616.86	1,864,149,617.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,313,996,616.86	1,864,149,617.84

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	10,468,798,142.60	8,229,234,659.45	18,698,032,802.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,313,996,616.86	-2,313,996,616.86
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）	782,750,442.63	471,675,439.53	1,254,425,882.16
其中：1.基金申购款	1,029,009,008.82	679,204,413.70	1,708,213,422.52
2.基金赎回款	-246,258,566.19	-207,528,974.17	-453,787,540.36
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）	11,251,548,585.23	6,386,913,482.12	17,638,462,067.35
项目	上年度可比期间 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

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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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[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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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增值税征收范围，不征收增值税。
- 2、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。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。
- 3、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- 4、存款利息收入不征收增值税。
- 5、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。

6、资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7、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。

8、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。

9、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。

10、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。

11、本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	31,619,059.57
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	31,619,059.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,537,926,958.30	17,220,733,920.51	682,806,962.21
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		16,537,926,958.30	17,220,733,920.51	682,806,962.21

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 2018年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	365,852,820.00	-	-	-
其中：股指期货	365,852,820.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	365,852,820.00	-	-	-

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
IF1807	沪深 300 股指期货 IF1807 合约	30	31,318,200.00	-2,077,020.00	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。
IF1809	沪深 300 股指期货 IF1809 合约	300	309,852,000.00	-22,605,600.00	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					-24,682,620.00
股指期货投资本期收益					1,015,983.99
股指期货投资本期公允价值变动					-27,770,340.00

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 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	280,000,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	280,000,000.00	-
----	----------------	---

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10,698.31
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	44,226.72
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	118,927.70
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	79.00
合计	173,931.73

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	937,250.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	937,250.55

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
可退替代款	2,411,489.94
应付指数使用费	1,333,739.88
应退替代款	995,644.34
预提费用	119,012.93
合计	4,859,887.09

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,285,149,828.00	10,468,798,142.60
本期申购	421,200,000.00	1,029,009,008.82
本期赎回（以“-”号填列）	-100,800,000.00	-246,258,566.19
本期末	4,605,549,828.00	11,251,548,585.23

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	11,047,113,837.86	-2,817,879,178.41	8,229,234,659.45
本期利润	1,406,156.14	-2,315,402,773.00	-2,313,996,616.86
本期基金份额交易产生的变动数	822,552,490.93	-350,877,051.40	471,675,439.53
其中：基金申购款	1,082,276,366.68	-403,071,952.98	679,204,413.70
基金赎回款	-259,723,875.75	52,194,901.58	-207,528,974.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,871,072,484.93	-5,484,159,002.81	6,386,913,482.12

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	1,130,372.74
其他	2,023.43
合计	1,344,903.74

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	54,733,426.79
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-118,710,608.93

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,358,119,736.66
减：卖出股票成本总额	1,531,563,772.38
买卖股票差价收入	-173,444,035.72

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	453,787,540.36
减：现金支付赎回款总额	150,402,610.36
减：赎回股票成本总额	248,651,503.21
赎回差价收入	54,733,426.79

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	23,881,616.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,026,600.00
减：应收利息总额	11,980.55
买卖债券差价收入	1,843,035.72

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 2018年1月1日至2018年6月30日
股指期货投资收益	1,015,983.99
合计	1,015,983.99

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	174,208,441.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	174,208,441.79

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-2,287,632,433.00
——股票投资	-2,287,701,033.00
——债券投资	68,600.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-27,770,340.00
——权证投资	-
——期货投资	-27,770,340.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-2,315,402,773.00

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-75,706.04
合计	-75,706.04

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	2,108,247.39
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,108,247.39

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	39,671.58
指数使用费	2,745,624.33
上市费用	29,752.78
银行费用	1,500.00
合计	2,866,137.26

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	45,760,405.46	40,908,531.91

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,152,081.09	8,181,706.33

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	1,689,733.00	0.04%	4,936,560.00	0.12%
华夏沪深 300ETF 联接	2,624,465,422.00	56.98%	2,420,278,422.00	56.48%

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	
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017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	31,619,059.57	212,507.57	230,349,200.29	1,433,255.48

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

2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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	113011	光大转债	老股东优先配售	189,130	18,913,000.00

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 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 1,974,396,120.00 元（上年度可比期间：133,273,980.00 元），支付给中信期货的佣金为 65,159.97 元（上年度可比期间：3,265.17 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（2018 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
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新发流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

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
------	------	------	------	--------	------	--------	----------	--------	--------	----

600221	海航控股	2018-01-10	重大事项	3.23	2018-07-20	2.91	18,554,700	62,508,739.13	59,931,681.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	-	-	2,180,969	54,260,814.08	31,820,337.71	-
601118	海南橡胶	2018-05-24	重大事项	6.62	-	-	2,021,126	13,363,699.53	13,379,854.12	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项	7.47	2018-8-20	7.25	9,257,826	87,208,788.92	69,155,960.22	-
601727	上海电气	2018-06-06	重大事项	6.34	2018-08-07	5.71	5,533,416	58,279,442.25	35,081,857.44	-
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项	4.96	2018-08-07	4.48	1,709,530	14,453,741.08	8,479,268.80	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项	5.84	2018-07-17	5.26	2,906,400	24,696,082.93	16,973,376.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项	4.87	-	-	6,740,025	39,044,036.72	32,823,921.75	-
000723	美锦能源	2018-03-27	重大事项	5.43	2018-07-31	4.89	1,937,400	14,147,262.41	10,520,082.00	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项	19.52	-	-	2,366,502	41,440,053.17	46,194,119.04	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项	15.03	-	-	2,107,787	34,103,143.51	31,680,038.61	-
002411	必康股份	2018-06-19	重大事项	28.34	-	-	461,281	12,395,571.37	13,072,703.54	-
002450	康得新	2018-06-04	重大事项	17.08	-	-	3,335,390	46,483,138.15	56,968,461.20	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项	32.50	-	-	439,270	14,815,014.99	14,276,275.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项	52.04	-	-	753,528	64,883,513.83	39,213,597.12	-
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项	23.28	2018-07-10	24.00	1,360,750	43,509,380.58	31,678,260.00	-

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票，如需对组合进行调整时，由于指数成份股流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹

配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	17,220,735,480.51	97.63	18,402,578,531.07	98.42
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	17,220,735,480.51	97.63	18,402,578,531.07	98.42

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	+5%	915,524,373.61	942,006,892.57
	-5%	-915,524,373.61	-942,006,892.57

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 2018 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 17,220,733,920.51 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2017 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 18,398,404,315.71 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 13,338,615.36 元。）

6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

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。

6.4.14.4 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	17,220,733,920.51	97.50
	其中：股票	17,220,733,920.51	97.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	280,000,000.00	1.59
	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	109,993,607.56	0.62
8	其他各项资产	51,620,590.66	0.29
9	合计	17,662,348,118.73	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	38,206,318.12	0.22
B	采矿业	556,036,722.10	3.15
C	制造业	7,301,811,467.78	41.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	458,156,593.10	2.60
E	建筑业	592,245,787.15	3.36
F	批发和零售业	334,691,840.99	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	552,805,537.76	3.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	639,403,008.26	3.63
J	金融业	5,414,456,943.30	30.70
K	房地产业	790,310,511.49	4.48
L	租赁和商务服务业	257,525,100.11	1.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	62,120,621.46	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	94,789,022.16	0.54
R	文化、体育和娱乐业	128,176,006.73	0.73
S	综合	-	-
	合计	17,220,735,480.51	97.63

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	17,411,736	1,019,979,495.00	5.78
2	600519	贵州茅台	808,589	591,450,509.90	3.35
3	600036	招商银行	16,579,314	438,357,062.20	2.49
4	000333	美的集团	7,415,523	387,238,611.10	2.20
5	000651	格力电器	7,735,230	364,716,094.50	2.07
6	601166	兴业银行	20,034,500	288,496,800.00	1.64
7	600887	伊利股份	9,769,992	272,582,776.80	1.55
8	600276	恒瑞医药	3,551,547	269,065,200.70	1.53
9	600016	民生银行	38,000,708	266,004,956.00	1.51
10	601328	交通银行	44,163,701	253,499,643.70	1.44
11	000858	五粮液	3,119,283	237,065,508.00	1.34
12	002415	海康威视	5,930,367	220,194,526.70	1.25
13	601288	农业银行	61,445,825	211,373,638.00	1.20
14	600030	中信证券	12,651,800	209,640,326.00	1.19
15	600104	上汽集团	5,633,830	197,127,711.70	1.12
16	000002	万科A	7,814,454	192,235,568.40	1.09
17	601398	工商银行	34,669,338	184,440,878.20	1.05
18	601668	中国建筑	33,754,394	184,298,991.20	1.04
19	600000	浦发银行	18,871,881	180,415,182.40	1.02
20	600900	长江电力	10,609,703	171,240,606.40	0.97
21	601601	中国太保	5,052,750	160,930,087.50	0.91
22	601169	北京银行	23,789,238	143,449,105.10	0.81
23	600048	保利地产	11,435,644	139,514,856.80	0.79
24	000725	京东方A	38,100,800	134,876,832.00	0.76
25	002304	洋河股份	969,154	127,540,666.40	0.72
26	000001	平安银行	13,799,426	125,436,782.30	0.71
27	600837	海通证券	13,007,364	123,179,737.10	0.70
28	601988	中国银行	33,877,352	122,297,240.70	0.69
29	600309	万华化学	2,636,348	119,742,926.20	0.68
30	600690	青岛海尔	5,880,644	113,261,203.40	0.64
31	002027	分众传媒	11,795,759	112,885,413.60	0.64
32	600019	宝钢股份	14,316,897	111,528,627.60	0.63
33	600518	康美药业	4,796,389	109,741,380.30	0.62
34	600028	中国石化	16,895,377	109,650,996.70	0.62

35	600585	海螺水泥	3,215,118	107,642,150.60	0.61
36	601888	中国国旅	1,568,964	101,056,971.20	0.57
37	601229	上海银行	6,272,750	98,858,540.00	0.56
38	603288	海天味业	1,303,565	95,994,526.60	0.54
39	601818	光大银行	25,596,082	93,681,660.12	0.53
40	601766	中国中车	11,731,083	90,329,339.10	0.51
41	000538	云南白药	837,758	89,606,595.68	0.51
42	601211	国泰君安	6,040,920	89,043,160.80	0.50
43	600009	上海机场	1,548,595	85,916,050.60	0.49
44	002024	苏宁易购	5,980,215	84,201,427.20	0.48
45	601939	建设银行	12,336,015	80,800,898.25	0.46
46	601857	中国石油	10,401,212	80,193,344.52	0.45
47	601688	华泰证券	5,249,398	78,583,488.06	0.45
48	601006	大秦铁路	9,559,400	78,482,674.00	0.44
49	600015	华夏银行	10,305,162	76,773,456.90	0.44
50	300059	东方财富	5,814,120	76,630,101.60	0.43
51	600703	三安光电	3,933,231	75,596,699.82	0.43
52	002230	科大讯飞	2,344,022	75,172,785.54	0.43
53	601009	南京银行	9,530,699	73,672,303.27	0.42
54	600050	中国联通	14,961,700	73,611,564.00	0.42
55	002008	大族激光	1,372,790	73,018,700.10	0.41
56	001979	招商蛇口	3,811,361	72,606,427.05	0.41
57	000568	泸州老窖	1,176,526	71,603,372.36	0.41
58	600919	江苏银行	11,134,100	71,369,581.00	0.40
59	002594	比亚迪	1,458,330	69,533,174.40	0.39
60	601390	中国中铁	9,257,826	69,155,960.22	0.39
61	002475	立讯精密	3,060,045	68,973,414.30	0.39
62	000338	潍柴动力	7,784,448	68,113,920.00	0.39
63	600196	复星医药	1,615,977	66,885,288.03	0.38
64	600031	三一重工	7,433,600	66,679,392.00	0.38
65	002142	宁波银行	4,074,522	66,373,963.38	0.38
66	601186	中国铁建	7,395,586	63,749,951.32	0.36
67	601088	中国神华	3,180,383	63,416,837.02	0.36
68	000776	广发证券	4,756,540	63,119,285.80	0.36
69	002236	大华股份	2,795,256	63,033,022.80	0.36
70	300003	乐普医疗	1,717,440	62,995,699.20	0.36
71	601628	中国人寿	2,677,181	60,290,116.12	0.34
72	601899	紫金矿业	16,679,500	60,212,995.00	0.34
73	600741	华域汽车	2,533,874	60,103,491.28	0.34
74	600221	海航控股	18,554,700	59,931,681.00	0.34
75	601989	中国重工	14,709,744	59,427,365.76	0.34
76	600660	福耀玻璃	2,252,731	57,917,714.01	0.33
77	601336	新华保险	1,341,641	57,529,566.08	0.33

78	002450	康得新	3,335,390	56,968,461.20	0.32
79	000963	华东医药	1,171,210	56,510,882.50	0.32
80	603799	华友钴业	571,319	55,686,462.93	0.32
81	600867	通化东宝	2,310,510	55,382,924.70	0.31
82	002466	天齐锂业	1,101,055	54,601,317.45	0.31
83	600436	片仔癀	485,322	54,322,091.46	0.31
84	601225	陕西煤业	6,426,500	52,825,830.00	0.30
85	300124	汇川技术	1,604,624	52,663,759.68	0.30
86	600958	东方证券	5,753,700	52,531,281.00	0.30
87	601012	隆基股份	3,140,686	52,418,049.34	0.30
88	000100	TCL 集团	17,387,479	50,423,689.10	0.29
89	600999	招商证券	3,676,582	50,295,641.76	0.29
90	600352	浙江龙盛	4,182,980	49,986,611.00	0.28
91	000063	中兴通讯	3,828,029	49,879,217.87	0.28
92	600795	国电电力	18,951,385	49,652,628.70	0.28
93	300015	爱尔眼科	1,532,764	49,492,949.56	0.28
94	002456	欧菲科技	3,047,415	49,154,803.95	0.28
95	600340	华夏幸福	1,900,438	48,936,278.50	0.28
96	002460	赣锋锂业	1,253,450	48,358,101.00	0.27
97	600029	南方航空	5,643,844	47,690,481.80	0.27
98	600886	国投电力	6,534,680	47,507,123.60	0.27
99	000166	申万宏源	10,866,877	47,488,252.49	0.27
100	600487	亨通光电	2,136,920	47,119,086.00	0.27
101	601933	永辉超市	6,153,160	47,010,142.40	0.27
102	600406	国电南瑞	2,947,185	46,565,523.00	0.26
103	002252	上海莱士	2,366,502	46,194,119.04	0.26
104	600271	航天信息	1,796,874	45,407,005.98	0.26
105	002044	美年健康	2,004,251	45,296,072.60	0.26
106	601155	新城控股	1,452,800	44,993,216.00	0.26
107	601607	上海医药	1,855,400	44,344,060.00	0.25
108	601901	方正证券	6,601,543	44,164,322.67	0.25
109	600011	华能国际	6,750,400	42,932,544.00	0.24
110	601111	中国国航	4,802,878	42,697,585.42	0.24
111	601985	中国核电	7,497,063	42,358,405.95	0.24
112	600570	恒生电子	795,374	42,115,053.30	0.24
113	600516	方大炭素	1,724,300	42,038,434.00	0.24
114	300070	碧水源	3,017,470	42,033,357.10	0.24
115	000895	双汇发展	1,590,824	42,013,661.84	0.24
116	600115	东方航空	6,298,200	41,694,084.00	0.24
117	600089	特变电工	5,965,881	41,343,555.33	0.23
118	002202	金风科技	3,269,547	41,327,074.08	0.23
119	600066	宇通客车	2,134,715	40,965,180.85	0.23
120	601600	中国铝业	10,569,646	40,587,440.64	0.23

121	600111	北方稀土	3,499,751	39,827,166.38	0.23
122	000423	东阿阿胶	734,879	39,543,838.99	0.22
123	300408	三环集团	1,678,546	39,445,831.00	0.22
124	601669	中国电建	7,358,980	39,444,132.80	0.22
125	601377	兴业证券	7,451,909	39,271,560.43	0.22
126	002739	万达电影	753,528	39,213,597.12	0.22
127	300136	信维通信	1,263,601	38,830,458.73	0.22
128	600606	绿地控股	5,867,600	38,374,104.00	0.22
129	000069	华侨城 A	5,270,345	38,104,594.35	0.22
130	600535	天士力	1,459,256	37,677,989.92	0.21
131	600588	用友网络	1,523,304	37,336,181.04	0.21
132	000413	东旭光电	6,149,000	37,262,940.00	0.21
133	600383	金地集团	3,628,075	36,970,084.25	0.21
134	600398	海澜之家	2,892,422	36,849,456.28	0.21
135	000503	国新健康	1,155,167	36,711,207.26	0.21
136	002736	国信证券	3,952,656	35,969,169.60	0.20
137	300122	智飞生物	771,300	35,279,262.00	0.20
138	601727	上海电气	5,533,416	35,081,857.44	0.20
139	000768	中航飞机	2,224,308	34,788,177.12	0.20
140	600522	中天科技	3,941,900	34,728,139.00	0.20
141	600176	中国巨石	3,381,700	34,594,791.00	0.20
142	601788	光大证券	3,139,400	34,470,612.00	0.20
143	600332	白云山	904,370	34,411,278.50	0.20
144	600010	包钢股份	21,922,625	33,980,068.75	0.19
145	000783	长江证券	6,200,812	33,670,409.16	0.19
146	600705	中航资本	7,192,846	33,590,590.82	0.19
147	002572	索菲亚	1,038,900	33,431,802.00	0.19
148	000540	中天金融	6,740,025	32,823,921.75	0.19
149	600893	航发动力	1,448,256	32,325,073.92	0.18
150	600068	葛洲坝	4,439,745	32,010,561.45	0.18
151	600637	东方明珠	2,122,370	31,962,892.20	0.18
152	002241	歌尔股份	3,129,364	31,888,219.16	0.18
153	600485	信威集团	2,180,969	31,820,337.71	0.18
154	002310	东方园林	2,107,787	31,680,038.61	0.18
155	300072	三聚环保	1,360,750	31,678,260.00	0.18
156	600085	同仁堂	882,400	31,131,072.00	0.18
157	600177	雅戈尔	4,023,432	30,980,426.40	0.18
158	601877	正泰电器	1,383,865	30,887,866.80	0.18
159	600674	川投能源	3,531,730	30,796,685.60	0.17
160	601998	中信银行	4,924,478	30,581,008.38	0.17
161	300024	机器人	1,754,507	30,528,421.80	0.17
162	600023	浙能电力	6,547,550	30,511,583.00	0.17
163	601919	中远海控	6,121,427	30,117,420.84	0.17

164	600739	辽宁成大	1,966,983	29,858,801.94	0.17
165	000157	中联重科	7,187,270	29,539,679.70	0.17
166	601198	东兴证券	2,215,800	28,894,032.00	0.16
167	002007	华兰生物	897,530	28,864,564.80	0.16
168	600018	上港集团	4,842,075	28,858,767.00	0.16
169	601618	中国中冶	8,592,500	28,613,025.00	0.16
170	000425	徐工机械	6,734,812	28,555,602.88	0.16
171	600547	山东黄金	1,193,314	28,544,070.88	0.16
172	002493	荣盛石化	2,759,900	28,482,168.00	0.16
173	000625	长安汽车	3,123,000	28,107,000.00	0.16
174	601800	中国交建	2,454,857	27,960,821.23	0.16
175	600804	鹏博士	2,302,327	27,627,924.00	0.16
176	300144	宋城演艺	1,166,837	27,420,669.50	0.16
177	601997	贵阳银行	2,216,000	27,389,760.00	0.16
178	000623	吉林敖东	1,493,899	26,860,304.02	0.15
179	000786	北新建材	1,439,800	26,679,494.00	0.15
180	601018	宁波港	6,335,000	26,670,350.00	0.15
181	600362	江西铜业	1,667,269	26,426,213.65	0.15
182	600208	新湖中宝	6,891,053	26,323,822.46	0.15
183	601555	东吴证券	3,852,172	26,310,334.76	0.15
184	600809	山西汾酒	417,900	26,281,731.00	0.15
185	600926	杭州银行	2,355,220	26,119,389.80	0.15
186	002065	东华软件	3,023,048	25,998,212.80	0.15
187	603833	欧派家居	201,964	25,756,468.92	0.15
188	002050	三花智控	1,364,000	25,711,400.00	0.15
189	002081	金螳螂	2,543,410	25,688,441.00	0.15
190	601099	太平洋	10,946,178	25,614,056.52	0.15
191	600816	安信信托	3,511,457	25,422,948.68	0.14
192	300017	网宿科技	2,352,832	25,198,830.72	0.14
193	600100	同方股份	2,859,326	25,104,882.28	0.14
194	002294	信立泰	671,868	24,973,333.56	0.14
195	002714	牧原股份	558,400	24,826,464.00	0.14
196	600482	中国动力	1,398,800	24,409,060.00	0.14
197	002146	荣盛发展	2,787,792	24,337,424.16	0.14
198	600109	国金证券	3,405,211	24,211,050.21	0.14
199	600219	南山铝业	8,915,000	24,159,650.00	0.14
200	000792	盐湖股份	2,231,264	24,142,276.48	0.14
201	000728	国元证券	3,245,741	24,018,483.40	0.14
202	603858	步长制药	547,746	23,438,051.34	0.13
203	002508	老板电器	762,507	23,347,964.34	0.13
204	002558	巨人网络	976,577	23,223,001.06	0.13
205	603993	洛阳钼业	3,690,837	23,215,364.73	0.13
206	601333	广深铁路	5,448,258	23,155,096.50	0.13

207	600297	广汇汽车	3,925,440	23,003,078.40	0.13
208	002797	第一创业	3,379,640	22,880,162.80	0.13
209	000630	铜陵有色	10,151,655	22,435,157.55	0.13
210	600498	烽火通信	895,776	22,260,033.60	0.13
211	600170	上海建工	7,137,175	21,697,012.00	0.12
212	000876	新希望	3,391,150	21,499,891.00	0.12
213	600438	通威股份	3,109,297	21,454,149.30	0.12
214	002673	西部证券	2,820,070	21,291,528.50	0.12
215	601117	中国化学	3,157,400	21,249,302.00	0.12
216	000839	中信国安	4,410,050	20,859,536.50	0.12
217	600549	厦门钨业	1,363,709	20,701,102.62	0.12
218	600153	建发股份	2,278,605	20,484,658.95	0.12
219	000826	启迪桑德	1,149,157	20,087,264.36	0.11
220	000709	河钢股份	6,803,000	20,068,850.00	0.11
221	002085	万丰奥威	2,099,900	19,739,060.00	0.11
222	002624	完美世界	633,400	19,641,734.00	0.11
223	000060	中金岭南	4,011,068	19,493,790.48	0.11
224	600977	中国电影	1,199,600	19,241,584.00	0.11
225	002352	顺丰控股	426,000	19,170,000.00	0.11
226	601633	长城汽车	1,939,512	19,046,007.84	0.11
227	600038	中直股份	474,829	18,988,411.71	0.11
228	000983	西山煤电	2,527,760	18,983,477.60	0.11
229	600489	中金黄金	2,766,522	18,867,680.04	0.11
230	600415	小商品城	4,375,004	18,856,267.24	0.11
231	601360	三六零	651,700	18,834,130.00	0.11
232	000961	中南建设	2,979,400	18,800,014.00	0.11
233	600188	兖州煤业	1,430,302	18,651,138.08	0.11
234	600583	海油工程	3,544,400	18,643,544.00	0.11
235	600663	陆家嘴	1,178,063	18,601,614.77	0.11
236	002500	山西证券	2,713,044	18,285,916.56	0.10
237	601216	君正集团	5,422,966	18,275,395.42	0.10
238	600118	中国卫星	952,391	18,190,668.10	0.10
239	600820	隧道股份	3,026,908	17,889,026.28	0.10
240	600346	恒力股份	1,217,442	17,847,699.72	0.10
241	600157	永泰能源	9,987,025	17,776,904.50	0.10
242	300433	蓝思科技	845,950	17,748,031.00	0.10
243	601992	金隅集团	5,335,300	17,499,784.00	0.10
244	600369	西南证券	4,528,958	17,436,488.30	0.10
245	002470	金正大	2,526,908	17,385,127.04	0.10
246	601228	广州港	2,984,000	17,337,040.00	0.10
247	000415	渤海金控	2,906,400	16,973,376.00	0.10
248	002555	三七互娱	1,387,025	16,852,353.75	0.10
249	601881	中国银河	2,065,500	16,792,515.00	0.10

250	000627	天茂集团	2,387,100	16,757,442.00	0.10
251	600909	华安证券	2,912,300	16,658,356.00	0.09
252	000898	鞍钢股份	2,964,100	16,510,037.00	0.09
253	300027	华谊兄弟	2,661,886	16,397,217.76	0.09
254	600008	首创股份	3,866,588	16,317,001.36	0.09
255	601021	春秋航空	442,400	15,497,272.00	0.09
256	000402	金融街	1,924,512	15,492,321.60	0.09
257	000671	阳光城	2,594,600	15,489,762.00	0.09
258	002074	国轩高科	1,089,030	15,311,761.80	0.09
259	000559	万向钱潮	2,199,134	14,954,111.20	0.08
260	002153	石基信息	512,976	14,876,304.00	0.08
261	600682	南京新百	897,600	14,756,544.00	0.08
262	000938	紫光股份	233,500	14,617,100.00	0.08
263	600376	首开股份	2,066,300	14,526,089.00	0.08
264	600704	物产中大	2,776,720	14,522,245.60	0.08
265	300251	光线传媒	1,418,400	14,439,312.00	0.08
266	002602	世纪华通	439,270	14,276,275.00	0.08
267	601898	中煤能源	2,942,500	14,212,275.00	0.08
268	002385	大北农	3,409,409	14,080,859.17	0.08
269	300033	同花顺	346,317	13,461,341.79	0.08
270	600688	上海石化	2,359,766	13,427,068.54	0.08
271	601118	海南橡胶	2,021,126	13,379,854.12	0.08
272	002411	必康股份	461,281	13,072,703.54	0.07
273	600959	江苏有线	2,494,967	12,724,331.70	0.07
274	600061	国投资本	1,366,220	12,678,521.60	0.07
275	002601	龙麟佰利	980,100	12,672,693.00	0.07
276	601866	中远海发	5,086,200	12,664,638.00	0.07
277	601991	大唐发电	3,981,649	12,064,396.47	0.07
278	600339	中油工程	2,677,300	12,021,077.00	0.07
279	600373	中文传媒	892,111	11,463,626.35	0.06
280	601238	广汽集团	1,026,360	11,433,650.40	0.06
281	601718	际华集团	2,802,336	11,265,390.72	0.06
282	600372	中航电子	856,864	11,190,643.84	0.06
283	000723	美锦能源	1,937,400	10,520,082.00	0.06
284	000959	首钢股份	2,544,646	10,458,495.06	0.06
285	601611	中国核建	1,266,900	10,008,510.00	0.06
286	601958	金钼股份	1,550,700	9,722,889.00	0.06
287	603160	汇顶科技	145,400	9,435,006.00	0.05
288	601808	中海油服	953,700	9,098,298.00	0.05
289	600025	华能水电	2,896,800	8,806,272.00	0.05
290	000008	神州高铁	1,709,530	8,479,268.80	0.05
291	002468	申通快递	492,100	8,439,515.00	0.05
292	603260	合盛硅业	118,000	8,327,260.00	0.05

293	002625	光启技术	691,830	8,101,329.30	0.05
294	002925	盈趣科技	145,734	8,070,748.92	0.05
295	601828	美凯龙	507,400	7,753,072.00	0.04
296	001965	招商公路	899,400	7,321,116.00	0.04
297	600233	圆通速递	542,558	7,161,765.60	0.04
298	601108	财通证券	625,500	7,055,640.00	0.04
299	600390	五矿资本	852,400	6,606,100.00	0.04
300	002608	江苏国信	858,100	5,920,890.00	0.03
301	601212	白银有色	1,350,300	5,522,727.00	0.03
302	601838	成都银行	629,300	5,506,375.00	0.03
303	601878	浙商证券	583,100	4,898,040.00	0.03
304	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.00
305	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
306	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
307	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	603288	海天味业	96,266,093.90	0.51
2	601229	上海银行	71,894,242.79	0.38
3	600867	通化东宝	54,851,170.48	0.29
4	600487	亨通光电	48,519,033.87	0.26
5	600516	方大炭素	44,330,443.78	0.24
6	000333	美的集团	41,928,590.80	0.22
7	300408	三环集团	40,450,301.96	0.22
8	000651	格力电器	39,182,065.35	0.21
9	600176	中国巨石	38,569,827.16	0.21
10	600398	海澜之家	37,530,835.14	0.20
11	000786	北新建材	31,774,276.65	0.17
12	002027	分众传媒	30,404,799.13	0.16
13	002493	荣盛石化	29,231,612.16	0.16
14	000858	五粮液	24,824,353.94	0.13
15	600809	山西汾酒	24,614,312.82	0.13
16	002050	三花智控	24,240,002.20	0.13
17	000002	万科A	23,764,104.21	0.13
18	600438	通威股份	23,124,786.70	0.12
19	002415	海康威视	23,092,242.31	0.12
20	002085	万丰奥威	22,131,781.27	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	601318	中国平安	58,672,101.10	0.31
2	600519	贵州茅台	42,842,298.32	0.23
3	000651	格力电器	29,331,684.29	0.16
4	600036	招商银行	25,471,151.50	0.14
5	000333	美的集团	25,285,530.80	0.14
6	002465	海格通信	24,613,739.13	0.13
7	600150	*ST 船舶	19,211,690.40	0.10
8	000750	国海证券	18,954,912.82	0.10
9	002415	海康威视	17,921,126.62	0.10
10	000002	万 科 A	17,790,367.27	0.10
11	300315	掌趣科技	17,733,982.84	0.09
12	601166	兴业银行	17,095,724.41	0.09
13	000686	东北证券	16,569,158.86	0.09
14	600895	张江高科	15,878,970.49	0.08
15	600887	伊利股份	15,803,800.16	0.08
16	600016	民生银行	15,577,441.52	0.08
17	600827	百联股份	14,992,646.21	0.08
18	300104	乐视网	14,767,752.72	0.08
19	000166	申万宏源	14,272,194.00	0.08
20	002174	游族网络	14,229,429.77	0.08

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	1,753,867,872.03
卖出股票的收入（成交）总额	1,358,119,736.66

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。

7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.7 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。

7.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.8.1 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
IF1807	沪深 300 股指期货 IF1807 合约	30	31,318,200.00	-2,077,020.00	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。
IF1809	沪深 300 股指期货 IF1809 合约	300	309,852,000.00	-22,605,600.00	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					-24,682,620.00
股指期货投资本期收益					1,015,983.99
股指期货投资本期公允价值变动					-27,770,340.00

7.8.2 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。

7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	51,350,993.02
2	应收证券清算款	95,665.91
3	应收股利	-
4	应收利息	173,931.73
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,620,590.66

7.10.4 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。

7.10.5 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。

7.10.6 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		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
4,318	1,066,593.29	1,922,702,486.00	41.75%	58,381,920.00	1.27%	2,624,465,422.00	56.98%

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	38.89%
2	中国人民人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	65,000,000.00	1.41%
3	汇丰人寿保险有限公司—积极进取投资账户	13,517,300.00	0.29%
4	中国人民财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品—008C—CT001 沪	12,530,000.00	0.27%
5	汇丰人寿保险有限公司—	9,455,200.00	0.21%

	平衡增长投资账户		
6	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	5,267,058.00	0.11%
7	天弘基金—中国银行—天弘惠理沪港深 4 号资产管理计划	3,480,900.00	0.08%
8	工银瑞信基金—建设银行—中国人寿—中国人寿保险股份有限公司委托工银瑞信基金管理	3,414,900.00	0.07%
9	华宝信托有限责任公司—宝鸿 5 号证券投资集合资金信托	2,420,818.00	0.05%
10	李成玉	2,393,900.00	0.05%
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	2,624,465,422.00	56.98%

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（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	4,285,149,828
本报告期基金总申购份额	421,200,000
减：本报告期基金总赎回份额	100,800,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,605,549,828

§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

本基金管理人于 2018 年 4 月 28 日发布公告，杨明辉先生代任华夏基金管理有限公司总经理，汤晓东先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于 2018 年 5 月 19 日发布公告，李一梅女士担任华夏基金管理有限公司总经理。

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	
国金证券	3	2,328,652,223.96	75.16%	305,782.02	75.16%	-
中银国际证券	1	769,763,406.63	24.84%	101,068.80	24.84%	-

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，本基金还选择了国泰君安证券、信达证券、中国银河证券、中信建投证券、上海证券、中投证券、新时代证券、东北证券、长江证券、兴业证券、天风证券、中金公司、中泰证券、方正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，方正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
国金证券	2,494,248.40	10.44%	6,208,000,000.00	100.00%
中银国际证券	21,387,367.87	89.56%	-	-

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杭州分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-31
2	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订旗下开放式基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-23
3	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对短期投资行为收取短期赎回费的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-23
4	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-28

5	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-19
---	--------------	--------------	------------

§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	2018-01-01 至 2018-06-30	1,790,942,652.00	-	-	1,790,942,652.00	38.89%
华夏沪深 300E TF 联接	1	2018-01-01 至 2018-06-30	2,420,278,422.00	311,912,500.00	107,725,500.00	2,624,465,422.00	56.98%
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正常运作水平，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

二〇一八年八月二十五日