

中小企业板交易型开放式指数基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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..... | 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..... | 27 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 27 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 28 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 28 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 31 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 32 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 32 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 32 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 32 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 32 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 32 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 33 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 33 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 33 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 35 |
| §10 重大事件揭示..... | 35 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 37 |
| §12 备查文件目录..... | 37 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|------------------|
| 基金名称 | 中小企业板交易型开放式指数基金 |
| 基金简称 | 华夏中小板 ETF |
| 场内简称 | 中小板 |
| 基金主代码 | 159902 |
| 交易代码 | 159902 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006 年 6 月 8 日 |
| 基金管理人 | 华夏基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 749,632,916.16 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2006 年 9 月 5 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 | 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为“中小企业板价格指数”。 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪反映中小企业板市场的标的指数，是股票基金中风险较高的产品。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|-----------------------------|-----------------------|
| 名称 | | 华夏基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 李彬 | 田青 |
| | 联系电话 | 400-818-6666 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | service@ChinaAMC.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-818-6666 | 010-67595096 |
| 传真 | | 010-63136700 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 北京市顺义区天竺空港工业区 A 区 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 100033 | 100033 |
| 法定代表人 | | 杨明辉 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ChinaAMC.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|--------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日） |
| 本期已实现收益 | -3,853,151.88 |
| 本期利润 | -367,193,726.49 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.4949 |
| 本期加权平均净值利润率 | -14.10% |
| 本期基金份额净值增长率 | -13.85% |
| 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 | 1,604,703,514.46 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 2.1407 |
| 期末基金资产净值 | 2,354,336,430.62 |
| 期末基金份额净值 | 3.141 |
| 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 | 229.18% |

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 | -8.48% | 1.72% | -8.73% | 1.71% | 0.25% | 0.01% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | -12.48% | 1.38% | -12.98% | 1.37% | 0.50% | 0.01% |
| 过去六个月 | -13.85% | 1.44% | -14.26% | 1.44% | 0.41% | 0.00% |
| 过去一年 | -6.27% | 1.23% | -6.75% | 1.23% | 0.48% | 0.00% |
| 过去三年 | -26.68% | 1.79% | -29.84% | 1.78% | 3.16% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 229.18% | 1.85% | 217.83% | 1.90% | 11.35% | -0.05% |

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

中小企业板交易型开放式指数基金

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

(2006 年 6 月 8 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 | 证券 | 说明 |
|----|----|-----------|----|----|
|----|----|-----------|----|----|

| | | (助理) 期限 | | 从业年限 | |
|----|------------------|------------|------|------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐猛 | 本基金的基金经理、数量投资部总监 | 2016-12-01 | - | 15年 | 清华大学工学硕士。曾任财富证券助理研究员，原中关村证券研究员等。2006年2月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部基金经理助理，上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2016年1月29日至2016年3月28日期间)等。 |

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中小板指数，中小板指数由中小板股票中规模大、流动性好、最具代表性的 100 只股票组成，自 2006 年 1 月 24 日起正式发布，以综合反映中小板市场整体表现，其作为中小板市场的核心指数，兼具价值尺度与投资标的功能。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动

而进行相应调整。

上半年，国际方面，美国经济增长强劲，美联储两次加息，美元大幅升值；欧洲则复苏态势有所波折，欧元下跌。国内方面，上半年 GDP 增长 6.8%，生产端，继续进行供给侧改革，并侧重于提供有效供给；需求端，基建与地产承压，美国发动的贸易战也增加了出口的不确定性。为控制风险，并着力于推进经济结构调整，货币政策组合整体呈紧信用、稳货币态势，同时，为确保在去杠杆的同时缓解小微企业融资难融资贵的问题，央行定向降准，进行结构性引导。汇率方面，美元升值明显，人民币贬值幅度较大。

市场方面，年初在配置资金涌入、外围经济向好尤其股票市场不断走高等因素带动下，A 股市场风险偏好明显提升，演绎了一波短促上涨；2 月初由于美国经济数据远超预期，引发市场对美联储超预期加息缩表的担忧，美国股市深度调整，并带动全球股市快速深跌，A 股市场随美国股市下跌并短暂反弹后又受贸易战、信用紧缩等因素拖累，重回调整。整体而言上半年 A 股市场呈震荡下行行情。

基金投资运作方面，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、赎回及成份股调整等工作。

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 3.141 元，本报告期份额净值增长率为-13.85%，同期中小板指数增长率为-14.26%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.41%，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，美国经济在美元回流、降税等因素影响下将仍会维持强势，但贸易战，也给当前世界经济格局带来较大冲击，其后续进展以及美联储推动的加息缩表，都给世界经济带来较大的不确定性，也是未来市场方面的重要变数。国内方面，由于外围因素的影响，政府将扩大内需予以对冲，但扩大内需并不意味着走老路，数量经济转向高质量发展的方向应是非常明确的。金融监管方面，力度与结构在边际上预计会有所调整，货币政策将更为稳定，财政政策的逆周期调整力度也将加大。

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，如果经济或政策超预期，市场情绪有望恢复，A 股市场有望呈震荡上涨走势，与此同时中小板股票具有明显的成长性优势和长期投资价值。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现为投资者获取指数投资收益及其他

模式盈利机会的投资目标。

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：本基金的每份基金份额享有同等分配权。当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。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 2 次。基金收益分配比例为不低于符合上述基金分红条件的可分配部分的 90%。本基金收益分配采取现金方式。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基

金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中小企业板交易型开放式指数基金

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 | 27,526,069.46 | 46,985,059.57 |
| 结算备付金 | | 175,000.14 | 338,288.28 |
| 存出保证金 | | 14,269.26 | 11,954.60 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,341,246,161.14 | 2,582,783,618.84 |
| 其中：股票投资 | | 2,341,246,161.14 | 2,575,369,918.84 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 7,413,700.00 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 1,671,817.79 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 7,668.44 | 9,984.52 |
| 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 | | 2,368,969,168.44 | 2,631,800,723.60 |
| 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 | | 12,215,442.44 | - |
| 应付赎回款 | | 40,340.45 | 424,647.96 |
| 应付管理人报酬 | | 1,003,365.21 | 1,120,752.73 |
| 应付托管费 | | 200,673.02 | 224,150.54 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 98,682.82 | 94,398.32 |
| 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 | 1,074,233.88 | 1,483,049.32 |
| 负债合计 | | 14,632,737.82 | 3,346,998.87 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 749,632,916.16 | 721,001,022.14 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 1,604,703,514.46 | 1,907,452,702.59 |
| 所有者权益合计 | | 2,354,336,430.62 | 2,628,453,724.73 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,368,969,168.44 | 2,631,800,723.60 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.141 元，基金份额总额 749,632,916.16 份。

6.2 利润表

会计主体：中小企业板交易型开放式指数基金

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 | | -359,157,680.06 | 191,619,722.52 |
| 1.利息收入 | | 128,287.37 | 158,879.59 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 125,994.08 | 158,879.59 |
| 债券利息收入 | | 2,293.29 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 4,439,294.91 | -23,018,848.40 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -11,973,255.79 | -37,847,446.74 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 1,128,265.06 | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.14 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|-----------------|----------------|
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 15,284,285.64 | 14,828,598.34 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | -363,340,574.61 | 214,551,348.74 |
| 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 | -384,687.73 | -71,657.41 |
| 减：二、费用 | | 8,036,046.43 | 7,526,737.05 |
| 1.管理人报酬 | | 6,444,446.04 | 5,849,972.69 |
| 2.托管费 | | 1,288,889.14 | 1,169,994.52 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | 6.4.7.20 | 176,812.06 | 382,597.51 |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.税金及附加 | | 5.58 | - |
| 7.其他费用 | 6.4.7.21 | 125,893.61 | 124,172.33 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -367,193,726.49 | 184,092,985.47 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -367,193,726.49 | 184,092,985.47 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中小企业板交易型开放式指数基金

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） | 721,001,022.14 | 1,907,452,702.59 | 2,628,453,724.73 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -367,193,726.49 | -367,193,726.49 |
| 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） | 28,631,894.02 | 64,444,538.36 | 93,076,432.38 |
| 其中：1.基金申购款 | 363,500,000.00 | 914,025,293.75 | 1,277,525,293.75 |
| 2.基金赎回款 | -334,868,105.98 | -849,580,755.39 | -1,184,448,861.37 |
| 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） | 749,632,916.16 | 1,604,703,514.46 | 2,354,336,430.62 |
| 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） | 776,897,977.45 | 1,641,005,331.02 | 2,417,903,308.47 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 184,092,985.47 | 184,092,985.47 |
| 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） | -45,472,445.49 | -105,273,970.03 | -150,746,415.52 |
| 其中：1.基金申购款 | 355,500,000.00 | 764,680,131.67 | 1,120,180,131.67 |
| 2.基金赎回款 | -400,972,445.49 | -869,954,101.70 | -1,270,926,547.19 |
| 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） | 731,425,531.96 | 1,719,824,346.46 | 2,451,249,878.42 |

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

中小企业板交易型开放式指数基金（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”）证监基金字[2006]92 号《关于同意中小企业板交易型开放式指数基金募集的批复》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》、《中小企业板交易型开放式指数基金基金合同》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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,965,335,792.44 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2006）第 66 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中小企业板交易型开放式指数基金基金合同》于 2006 年 6 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,965,967,258.69 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中小企业板交易型开放式指数基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股，可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2006]106 号文审核同意，本基金 2,329,107,641 份基金份额于 2006 年 9 月 5 日在深交所挂牌交易。投资者可使用深圳证券账户，采用组合证券方式，通过深交所场内系统办理申购、赎回业务（以下简称“场内申购、赎回”）。投资者可使用开放式基金账户，采用现金方式，通过基金管理人办理申购、赎回业务（以下简称“场外申购、赎回”）。自 2006 年 9 月 11 日起，投资者可使用开放式基金账户，采用现金方式，通过场外申购、赎回代理机构办理场外申购、赎回。

根据《中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书》（更新），基金管理人将对当日场外申购、赎回进行轧差处理，运用净申购资金根据当日申购赎回清单买入相应的组合证券对价或根据当日申购赎回清单卖出相应的组合证券对价。

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 | 27,526,069.46 |
| 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 | 27,526,069.46 |

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 | 2,559,397,578.11 | 2,341,246,161.14 | -218,151,416.97 |
| 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 | 2,559,397,578.11 | 2,341,246,161.14 | -218,151,416.97 |

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

无。

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

无。

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 | 7,406.29 |
| 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 | 255.75 |
| 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 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 6.40 |
| 合计 | 7,668.44 |

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 | 98,682.82 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 98,682.82 |

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 | 152.05 |
| 预提费用 | 123,972.33 |
| 应退替代款 | 13,064.40 |
| 可退替代款 | 937,045.10 |
| 合计 | 1,074,233.88 |

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 | 721,001,022.14 | 721,001,022.14 |
| 本期申购 | 363,500,000.00 | 363,500,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -334,868,105.98 | -334,868,105.98 |
| 本期末 | 749,632,916.16 | 749,632,916.16 |

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 | 2,118,226,097.95 | -210,773,395.36 | 1,907,452,702.59 |
| 本期利润 | -3,853,151.88 | -363,340,574.61 | -367,193,726.49 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 84,617,053.61 | -20,172,515.25 | 64,444,538.36 |
| 其中：基金申购款 | 1,077,057,622.95 | -163,032,329.20 | 914,025,293.75 |
| 基金赎回款 | -992,440,569.34 | 142,859,813.95 | -849,580,755.39 |
| 本期已分配利润 | 0.00 | - | - |
| 本期末 | 2,198,989,999.68 | -594,286,485.22 | 1,604,703,514.46 |

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 | 6,805.97 |
| 其他 | 134.54 |
| 合计 | 125,994.08 |

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 | 20,955,657.66 |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -11,973,255.79 |

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 | 112,042,263.09 |
| 减：卖出股票成本总额 | 144,971,176.54 |
| 买卖股票差价收入 | -32,928,913.45 |

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 | 1,158,054,214.22 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 12,169,693.22 |
| 减：赎回股票成本总额 | 1,124,928,863.34 |
| 赎回差价收入 | 20,955,657.66 |

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 | 12,782,047.74 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 11,650,600.00 |
| 减：应收利息总额 | 3,182.68 |
| 买卖债券差价收入 | 1,128,265.06 |

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

无。

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 | 15,284,285.64 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 15,284,285.64 |

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 | -363,340,574.61 |
| ——股票投资 | -363,340,574.61 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.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 | -363,340,574.61 |

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 | 32,993.29 |
| 替代损益 | -417,681.02 |
| 合计 | -384,687.73 |

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 | 176,812.06 |
| 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 | 176,812.06 |

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 | 54,547.97 |
| 信息披露费 | 39,671.58 |
| 银行费用 | 1,921.28 |
| 上市费 | 29,752.78 |
| 合计 | 125,893.61 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------|
| 华夏基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人 |

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 | 6,444,446.04 | 5,849,972.69 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 241,891.14 | 250,333.89 |

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。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费 | 1,288,889.14 | 1,169,994.52 |

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

无。

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 |
| 中国建设银行活期存款 | 27,526,069.46 | 119,053.57 | 33,119,626.83 | 152,190.04 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

无。

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

无。

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 |
|--------|------|------------|------|--------|------|--------|--------------|---------------|---------------|----|
| 002075 | 沙钢股份 | 2016-09-19 | 重大事项 | 16.12 | - | - | 508,160 | 8,132,934.76 | 8,191,539.20 | - |
| 002739 | 万达电影 | 2017-07-04 | 重大事项 | 52.04 | - | - | 490,115 | 27,758,661.31 | 25,505,584.60 | - |
| 002252 | 上海 | 2018-02-23 | 重大 | 19.52 | - | - | 1,750,811 | 35,260,542.76 | 34,175,830.72 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------|-------|------------|------|-----------|---------------|---------------|---|
| | 莱士 | | 事项 | | | | | | | |
| 002051 | 中工国际 | 2018-04-09 | 重大事项 | 15.27 | - | - | 638,883 | 11,796,656.88 | 9,755,743.41 | - |
| 002310 | 东方园林 | 2018-05-25 | 重大事项 | 15.03 | - | - | 1,886,355 | 33,841,662.92 | 28,351,915.65 | - |
| 002431 | 棕榈股份 | 2018-05-30 | 重大事项 | 6.71 | - | - | 1,157,000 | 9,306,483.21 | 7,763,470.00 | - |
| 002450 | 康得新 | 2018-06-04 | 重大事项 | 17.08 | - | - | 3,218,923 | 66,693,714.10 | 54,979,204.84 | - |
| 002411 | 必康股份 | 2018-06-19 | 重大事项 | 28.34 | - | - | 317,905 | 8,752,990.62 | 9,009,427.70 | - |
| 002426 | 胜利精密 | 2018-06-19 | 重大事项 | 3.60 | 2018-07-03 | 3.26 | 2,633,946 | 16,454,459.51 | 9,482,205.60 | - |
| 002573 | 清新环境 | 2018-06-19 | 重大事项 | 11.55 | - | - | 874,972 | 16,041,935.32 | 10,105,926.60 | - |

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 | 2,341,246,161.14 | 99.44 | 2,575,369,918.84 | 97.98 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,341,246,161.14 | 99.44 | 2,575,369,918.84 | 97.98 |

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中小企业板价格指数变动时，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、假定中小企业板价格指数变化 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% | 123,379,000.65 | 134,563,688.44 |
| | -5% | -123,379,000.65 | -134,563,688.44 |

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 2,341,246,161.14 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，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 2,582,783,618.84 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 | 2,341,246,161.14 | 98.83 |
| | 其中：股票 | 2,341,246,161.14 | 98.83 |
| 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 | - | - |
| | 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 | 27,701,069.60 | 1.17 |

| | | | |
|---|--------|------------------|--------|
| 8 | 其他各项资产 | 21,937.70 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 2,368,969,168.44 | 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 | 21,194,393.22 | 0.90 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,554,655,318.56 | 66.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 65,381,157.66 | 2.78 |
| F | 批发和零售业 | 92,042,446.70 | 3.91 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 16,119,620.00 | 0.68 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 259,417,701.35 | 11.02 |
| J | 金融业 | 140,215,183.42 | 5.96 |
| K | 房地产业 | 30,338,664.87 | 1.29 |
| L | 租赁和商务服务业 | 83,889,024.56 | 3.56 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 10,105,926.60 | 0.43 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 42,381,192.40 | 1.80 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 25,505,584.60 | 1.08 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,341,246,213.94 | 99.44 |

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 | 002415 | 海康威视 | 4,611,572 | 171,227,668.36 | 7.27 |
| 2 | 002304 | 洋河股份 | 776,207 | 102,148,841.20 | 4.34 |
| 3 | 002027 | 分众传媒 | 7,328,088 | 70,129,802.16 | 2.98 |
| 4 | 002230 | 科大讯飞 | 2,126,340 | 68,191,723.80 | 2.90 |
| 5 | 002024 | 苏宁易购 | 4,809,316 | 67,715,169.28 | 2.88 |
| 6 | 002008 | 大族激光 | 1,226,174 | 65,220,195.06 | 2.77 |
| 7 | 002475 | 立讯精密 | 2,512,279 | 56,626,768.66 | 2.41 |
| 8 | 002594 | 比亚迪 | 1,172,686 | 55,913,668.48 | 2.37 |
| 9 | 002450 | 康得新 | 3,218,923 | 54,979,204.84 | 2.34 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 10 | 002236 | 大华股份 | 2,289,065 | 51,618,415.75 | 2.19 |
| 11 | 002142 | 宁波银行 | 3,136,321 | 51,090,669.09 | 2.17 |
| 12 | 002466 | 天齐锂业 | 1,006,040 | 49,889,523.60 | 2.12 |
| 13 | 002456 | 欧菲科技 | 2,791,870 | 45,032,863.10 | 1.91 |
| 14 | 002044 | 美年健康 | 1,875,274 | 42,381,192.40 | 1.80 |
| 15 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,056,856 | 40,773,504.48 | 1.73 |
| 16 | 002422 | 科伦药业 | 1,260,507 | 40,462,274.70 | 1.72 |
| 17 | 002202 | 金风科技 | 2,982,730 | 37,701,707.20 | 1.60 |
| 18 | 002252 | 上海莱士 | 1,750,811 | 34,175,830.72 | 1.45 |
| 19 | 002310 | 东方园林 | 1,886,355 | 28,351,915.65 | 1.20 |
| 20 | 002241 | 歌尔股份 | 2,734,308 | 27,862,598.52 | 1.18 |
| 21 | 002572 | 索菲亚 | 829,978 | 26,708,692.04 | 1.13 |
| 22 | 002739 | 万达电影 | 490,115 | 25,505,584.60 | 1.08 |
| 23 | 002410 | 广联达 | 912,917 | 25,315,188.41 | 1.08 |
| 24 | 002007 | 华兰生物 | 764,418 | 24,583,682.88 | 1.04 |
| 25 | 002340 | 格林美 | 4,010,738 | 24,264,964.90 | 1.03 |
| 26 | 002405 | 四维图新 | 1,197,964 | 24,258,771.00 | 1.03 |
| 27 | 002049 | 紫光国微 | 541,070 | 23,872,008.40 | 1.01 |
| 28 | 002736 | 国信证券 | 2,532,733 | 23,047,870.30 | 0.98 |
| 29 | 002001 | 新 和 成 | 1,204,200 | 22,831,632.00 | 0.97 |
| 30 | 002038 | 双鹭药业 | 587,460 | 22,317,605.40 | 0.95 |
| 31 | 002050 | 三花智控 | 1,177,500 | 22,195,875.00 | 0.94 |
| 32 | 002179 | 中航光电 | 563,221 | 21,965,619.00 | 0.93 |
| 33 | 002146 | 荣盛发展 | 2,489,408 | 21,732,531.84 | 0.92 |
| 34 | 002065 | 东华软件 | 2,500,718 | 21,506,174.80 | 0.91 |
| 35 | 002271 | 东方雨虹 | 1,262,033 | 21,467,181.33 | 0.91 |
| 36 | 002714 | 牧原股份 | 476,707 | 21,194,393.22 | 0.90 |
| 37 | 002508 | 老板电器 | 667,454 | 20,437,441.48 | 0.87 |
| 38 | 002673 | 西部证券 | 2,673,600 | 20,185,680.00 | 0.86 |
| 39 | 002311 | 海大集团 | 949,663 | 20,037,889.30 | 0.85 |
| 40 | 002797 | 第一创业 | 2,950,660 | 19,975,968.20 | 0.85 |
| 41 | 002268 | 卫 士 通 | 900,500 | 19,657,915.00 | 0.83 |
| 42 | 002081 | 金 螳 螂 | 1,931,686 | 19,510,028.60 | 0.83 |
| 43 | 002092 | 中泰化学 | 2,011,178 | 19,387,755.92 | 0.82 |
| 44 | 002129 | 中环股份 | 2,466,156 | 19,310,001.48 | 0.82 |
| 45 | 002294 | 信立泰 | 506,728 | 18,835,079.76 | 0.80 |
| 46 | 002465 | 海格通信 | 2,221,438 | 17,838,147.14 | 0.76 |
| 47 | 002078 | 太阳纸业 | 1,802,700 | 17,468,163.00 | 0.74 |
| 48 | 002176 | 江特电机 | 1,748,500 | 16,995,420.00 | 0.72 |
| 49 | 002085 | 万丰奥威 | 1,804,666 | 16,963,860.40 | 0.72 |
| 50 | 002195 | 二三四五 | 3,944,190 | 16,881,133.20 | 0.72 |
| 51 | 002223 | 鱼跃医疗 | 834,607 | 16,266,490.43 | 0.69 |
| 52 | 002439 | 启明星辰 | 763,698 | 16,205,671.56 | 0.69 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 53 | 002110 | 三钢闽光 | 987,600 | 15,831,228.00 | 0.67 |
| 54 | 002217 | 合力泰 | 1,903,327 | 15,702,447.75 | 0.67 |
| 55 | 002019 | 亿帆医药 | 889,600 | 15,701,440.00 | 0.67 |
| 56 | 002500 | 山西证券 | 2,284,898 | 15,400,212.52 | 0.65 |
| 57 | 002624 | 完美世界 | 491,856 | 15,252,454.56 | 0.65 |
| 58 | 002470 | 金正大 | 2,038,008 | 14,021,495.04 | 0.60 |
| 59 | 002013 | 中航机电 | 1,848,084 | 13,989,995.88 | 0.59 |
| 60 | 002221 | 东华能源 | 1,422,500 | 13,897,825.00 | 0.59 |
| 61 | 002183 | 怡亚通 | 2,069,056 | 13,759,222.40 | 0.58 |
| 62 | 002074 | 国轩高科 | 966,450 | 13,588,287.00 | 0.58 |
| 63 | 002185 | 华天科技 | 2,366,746 | 13,348,447.44 | 0.57 |
| 64 | 002153 | 石基信息 | 458,640 | 13,300,560.00 | 0.56 |
| 65 | 002385 | 大北农 | 3,117,543 | 12,875,452.59 | 0.55 |
| 66 | 002371 | 北方华创 | 258,000 | 12,814,860.00 | 0.54 |
| 67 | 002558 | 巨人网络 | 537,664 | 12,785,649.92 | 0.54 |
| 68 | 002384 | 东山精密 | 518,000 | 12,432,000.00 | 0.53 |
| 69 | 002273 | 水晶光电 | 960,698 | 12,364,183.26 | 0.53 |
| 70 | 002497 | 雅化集团 | 1,152,600 | 12,148,404.00 | 0.52 |
| 71 | 002281 | 光迅科技 | 544,500 | 11,543,400.00 | 0.49 |
| 72 | 002352 | 顺丰控股 | 254,000 | 11,430,000.00 | 0.49 |
| 73 | 002280 | 联络互动 | 1,941,475 | 11,105,237.00 | 0.47 |
| 74 | 002407 | 多氟多 | 785,500 | 11,012,710.00 | 0.47 |
| 75 | 002491 | 通鼎互联 | 975,800 | 10,802,106.00 | 0.46 |
| 76 | 002366 | 台海核电 | 748,200 | 10,669,332.00 | 0.45 |
| 77 | 002670 | 国盛金控 | 976,303 | 10,514,783.31 | 0.45 |
| 78 | 002640 | 跨境通 | 694,371 | 10,429,452.42 | 0.44 |
| 79 | 002583 | 海能达 | 1,237,700 | 10,334,795.00 | 0.44 |
| 80 | 002573 | 清新环境 | 874,972 | 10,105,926.60 | 0.43 |
| 81 | 002600 | 领益智造 | 1,898,000 | 9,850,620.00 | 0.42 |
| 82 | 002051 | 中工国际 | 638,883 | 9,755,743.41 | 0.41 |
| 83 | 002426 | 胜利精密 | 2,633,946 | 9,482,205.60 | 0.40 |
| 84 | 002709 | 天赐材料 | 238,927 | 9,208,246.58 | 0.39 |
| 85 | 002151 | 北斗星通 | 354,000 | 9,097,800.00 | 0.39 |
| 86 | 002131 | 利欧股份 | 4,322,201 | 9,076,622.10 | 0.39 |
| 87 | 002168 | 深圳惠程 | 877,269 | 9,018,325.32 | 0.38 |
| 88 | 002411 | 必康股份 | 317,905 | 9,009,427.70 | 0.38 |
| 89 | 002152 | 广电运通 | 1,523,206 | 8,956,451.28 | 0.38 |
| 90 | 002601 | 龙蟠佰利 | 687,800 | 8,893,254.00 | 0.38 |
| 91 | 002285 | 世联行 | 1,372,589 | 8,606,133.03 | 0.37 |
| 92 | 002075 | 沙钢股份 | 508,160 | 8,191,539.20 | 0.35 |
| 93 | 002424 | 贵州百灵 | 720,916 | 8,189,605.76 | 0.35 |
| 94 | 002431 | 棕榈股份 | 1,157,000 | 7,763,470.00 | 0.33 |
| 95 | 002292 | 奥飞娱乐 | 790,846 | 7,062,254.78 | 0.30 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 96 | 002635 | 安洁科技 | 350,750 | 6,032,900.00 | 0.26 |
| 97 | 002555 | 三七互娱 | 484,000 | 5,880,600.00 | 0.25 |
| 98 | 002010 | 传化智联 | 419,879 | 5,101,529.85 | 0.22 |
| 99 | 002120 | 韵达股份 | 88,400 | 4,689,620.00 | 0.20 |

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 | 002268 | 卫士通 | 18,686,128.51 | 0.71 |
| 2 | 002110 | 三钢闽光 | 15,672,343.08 | 0.60 |
| 3 | 002019 | 亿帆医药 | 14,605,678.61 | 0.56 |
| 4 | 002221 | 东华能源 | 13,678,343.29 | 0.52 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 11,818,916.41 | 0.45 |
| 6 | 002281 | 光迅科技 | 11,216,755.92 | 0.43 |
| 7 | 002670 | 国盛金控 | 10,396,597.61 | 0.40 |
| 8 | 002640 | 跨境通 | 10,283,634.56 | 0.39 |
| 9 | 002600 | 领益智造 | 9,683,624.80 | 0.37 |
| 10 | 002151 | 北斗星通 | 8,933,800.90 | 0.34 |
| 11 | 002450 | 康得新 | 8,797,980.35 | 0.33 |
| 12 | 002466 | 天齐锂业 | 5,402,795.00 | 0.21 |
| 13 | 002027 | 分众传媒 | 3,658,022.80 | 0.14 |
| 14 | 002714 | 牧原股份 | 2,973,607.49 | 0.11 |
| 15 | 002583 | 海能达 | 2,833,249.00 | 0.11 |
| 16 | 002470 | 金正大 | 2,785,706.00 | 0.11 |
| 17 | 002050 | 三花智控 | 2,568,222.00 | 0.10 |
| 18 | 002085 | 万丰奥威 | 2,474,956.00 | 0.09 |
| 19 | 002594 | 比亚迪 | 2,472,438.00 | 0.09 |
| 20 | 002366 | 台海核电 | 2,419,460.76 | 0.09 |

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 | 002030 | 达安基因 | 11,965,638.65 | 0.46 |
| 2 | 002353 | 杰瑞股份 | 11,129,657.30 | 0.42 |
| 3 | 002399 | 海普瑞 | 11,068,537.76 | 0.42 |
| 4 | 002701 | 奥瑞金 | 9,951,640.29 | 0.38 |
| 5 | 002004 | 华邦健康 | 9,458,542.90 | 0.36 |
| 6 | 002299 | 圣农发展 | 9,343,348.86 | 0.36 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 7 | 002108 | 沧州明珠 | 7,334,582.38 | 0.28 |
| 8 | 002400 | 省广集团 | 6,783,156.06 | 0.26 |
| 9 | 002276 | 万马股份 | 4,987,520.43 | 0.19 |
| 10 | 002018 | *ST 华信 | 2,013,741.96 | 0.08 |
| 11 | 002610 | 爱康科技 | 1,599,924.00 | 0.06 |
| 12 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,491,126.69 | 0.06 |
| 13 | 002023 | 海特高新 | 1,195,567.50 | 0.05 |
| 14 | 002716 | 金贵银业 | 1,151,964.00 | 0.04 |
| 15 | 002489 | 浙江永强 | 1,125,881.85 | 0.04 |
| 16 | 002368 | 太极股份 | 1,107,790.80 | 0.04 |
| 17 | 002415 | 海康威视 | 1,051,567.00 | 0.04 |
| 18 | 002437 | 誉衡药业 | 950,767.42 | 0.04 |
| 19 | 002304 | 洋河股份 | 937,344.00 | 0.04 |
| 20 | 002657 | 中科金财 | 907,374.32 | 0.03 |

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 | 180,255,245.79 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 112,042,263.09 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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 | 14,269.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,668.44 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 21,937.70 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 30,065 | 24,933.74 | 395,940,631.44 | 52.82% | 353,692,284.72 | 47.18% |

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 | 中国证券金融股份有限公司 | 300,500,000.00 | 47.97% |
| 2 | 华融证券股份有限公司融券专用证券账户 | 8,540,100.00 | 1.36% |
| 3 | 许卫 | 8,456,000.00 | 1.35% |
| 4 | 白洞明 | 7,257,673.00 | 1.16% |
| 5 | 农银人寿保险股份有限公司-万能 | 6,100,000.00 | 0.97% |
| 6 | 百年人寿保险股份有限公司-万能保险产品 | 5,600,000.00 | 0.89% |
| 7 | 农银人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品 | 5,300,000.00 | 0.85% |
| 8 | 陈惠 | 4,307,800.00 | 0.69% |
| 9 | 工银瑞信添富股票型养老金产品-中国农业银行股份有限公司 | 4,060,708.00 | 0.65% |
| 10 | 国信证券股份有限公司 | 4,009,100.00 | 0.64% |

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 | 4,210.99 | 0.00% |

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（2006年6月8日）基金份额总额 | 3,965,967,258.69 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 721,001,022.14 |
| 本报告期基金总申购份额 | 363,500,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 334,868,105.98 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 749,632,916.16 |

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备 |
|------|------|------|-----------|---|
|------|------|------|-----------|---|

| | 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 | 注 |
|------------|----|----------------|------------------|-----------|----------------|---|
| 申万宏源 证券 | 2 | 292,097,139.59 | 100.00% | 38,352.18 | 100.00% | - |

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了光大证券、国泰君安证券、海通证券、万联证券、中国银河证券、中信建投证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，万联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 |
| 申万宏源证券 | 12,782,047.74 | 100.00% | - | - |

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》 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2018-03-23 |

| | | | |
|---|--|--------------|------------|
| | 修订旗下开放式基金基金合同的公告 | | |
| 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 | 300,500,000.00 | - | - | 300,500,000.00 | 40.09% |
| 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 《中小企业板交易型开放式指数基金基金合同》；
- 12.1.3 《中小企业板交易型开放式指数基金托管协议》；
- 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