

华夏沪深 300 交易型开放式指数

证券投资基金

2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：二〇一九年三月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2019 年 3 月 22 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 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	7,563,849,828 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 1 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-354,440,055.17	396,858,292.55	127,416,644.65
本期利润	-5,189,609,641.33	3,661,856,430.76	-1,511,650,040.52
加权平均基金份额本期利润	-1.0124	0.8341	-0.3233
本期加权平均净值利润率	-26.45%	21.12%	-9.53%
本期基金份额净值增长率	-23.88%	23.69%	-8.59%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	4,331,976,997.39	8,229,234,659.45	4,963,727,153.90
期末可供分配基金份额利润	0.5727	1.9204	1.0846
期末基金资产净值	22,810,774,752.45	18,698,032,802.05	16,144,916,148.87
期末基金份额净值	3.0158	4.3634	3.5276
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	40.57%	84.66%	49.29%

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
过去三个月	-12.44%	1.64%	-12.45%	1.64%	0.01%	0.00%
过去六个月	-13.27%	1.50%	-14.25%	1.50%	0.98%	0.00%
过去一年	-23.88%	1.34%	-25.31%	1.34%	1.43%	0.00%
过去三年	-13.93%	1.17%	-19.31%	1.18%	5.38%	-0.01%
过去五年	43.94%	1.53%	29.21%	1.53%	14.73%	0.00%
自基金合同生效起至今	40.57%	1.53%	26.43%	1.51%	14.14%	0.02%

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

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 12 月 25 日至 2018 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额	现金形式发放总	再投资形式发放	年度利润分配合	备
----	----------	---------	---------	---------	---

	分红数	额	总额	计	注
2016 年	-	-	-	-	-
2017 年	-	-	-	-	-
2018 年	3.233	2,287,538,229.35	-	2,287,538,229.35	-
合计	3.233	2,287,538,229.35	-	2,287,538,229.35	-

§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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2012-12-25	-	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》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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，本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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 3 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。

2018 年，国际方面，全球经济总体延续复苏态势，但不同经济体间差异扩大，全球经济增长同步性降低，金融市场、大宗商品价格剧烈波动、全球投资大幅下滑、全球贸易保护主义及单边主义盛行。发达经济体的金融环境自秋季以来已收紧，在贸易紧张局势升级、全球增长预计放缓的环境下，对收益前景的乐观情绪减弱，股票市场随之回落；接近年底时，对美国政府“停摆”的担忧进一步影响了金融部门的情绪，主要国家央行也采取了更谨慎的措施。新兴市场和发展中经济体经受了艰难的外部环境考验，包括贸易紧张局势、美国利率上升、美元升值、资本外流和石油价格波动不定；金融环境略有收紧，各国特定因素导致各自情况存在较大差异。在错综复杂的国内外环境下，中国经济运行实现了总体平稳、稳中有进，经济社会发展的主要预期目标较好实现，国内生产总值比上年增长 6.6%，实现了 6.5% 左右的预期增长目标；内生动力进一步增强，消费对经济增长的基础作用更加显著；产业结构持续优化，服务业对经济增长的贡献持续提升；经济增长质量提高，新动能成为经济发展增添了活力。

市场方面，A 股市场整体处于震荡调整之中，市场指数出现大幅下跌。1 季度，受海外市场影响出现了剧烈波动，A 股指数先扬后抑；2 季度，受外部因素影响，A 股市场情绪承压，市场成交呈现较为明显的萎缩态势，A 股正式纳入 MSCI 新兴市场指数，但并未能改变市场跌势；3 季度，A 股指数继续震荡走低，两市成交持续萎缩，A 股纳入 MSCI 指数比例提高至 5%；4 季度，受美债收益率抬升、美股大跌等外部扰动因素的影响，A 股指数发生急跌，高层接连表态，传递维稳股市信号，持续夯实政策底。

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。此外，报告期内，基金分红 2 次，共计分红 3.233 元/10 份。

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

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、广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司等。

目前该基金已被调入融资融券标的的证券名单。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 3.0158 元，本报告期份额净值增长率为-23.88%，同期沪深 300 指数增长率-25.31%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.43%，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 2019 年，全球经济前景面临的主要风险来自于贸易谈判的结果和未来几个月金融市场情绪变化的方向。国际方面，随着美国取消财政刺激、联邦基金利率暂时超过中性利率，预计增长率将下降；欧元区许多经济体的增长率将被下调；英国脱欧结果持续不确定的负面影响或与当年预算宣布的财政刺激的正面影响相互抵消；日本对经济提供进一步财政支持，实施消费税缓解措施，经济增速预测上调。国内方面，经济发展的外部环境更加复杂严峻，国内的结构性矛盾仍然突出，尽管政府采取了财政刺激措施，对美国关税提高的影响产生了一定抵消作用，但在必要的金融监管收紧措施以及与美国贸易矛盾的共同作用下，中国经济仍将保持平稳增长。

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

珍惜基金份额持有人的每一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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司认真落实资管新规及其配套规则、债券交易合规管理、货币市场基金互联网销售等行业新规，紧密跟踪监管要求，促进公司业务合法合规；公司不断完善内部制度建设，制定了非居民金融账户涉税信息尽职调查管理制度、案件管理制度、合同管理制度、知识产权管理制度等多项制度，修订了投资者适当性管理制度，编制了合规管理白皮书；公司以投资研究和销售业务条线为重点，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为和新颁布的法律法规，开展合规培训，不断提升员工的合规守法意识；强化事前事中合规风险管理，对信息披露文件严格把关，认真审核基金宣传推介材料，加强销售行为管理，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管

理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，在持续对日常投资运作进行监督的同时，加强对基金流动性风险的管理、投资组合强制合规管理，督促投研交易业务的合规开展。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资决策、投资研究、交易执行、基金销售、信息技术等关键业务和岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 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。

本基金本报告期实施利润分配 2 次，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持

有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

本报告期内，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金对基金份额持有人进行了 2 次利润分配，分配金额为 2,287,538,229.35 元。

5.3 托管人对本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 审计报告

普华永道中天审字（2019）第 22414 号

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（1）我们审计的内容

我们审计了华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“华夏沪深 300ETF 基金”）的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

（2）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏沪深 300ETF 基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、

适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏沪深 300ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏沪深 300ETF 基金的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏沪深 300ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏沪深 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏沪深 300ETF 基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏沪深 300ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基

于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致华夏沪深 300ETF 基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
单峰 赵雪

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

2019 年 3 月 22 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		52,953,969.88	18,009,104.33
结算备付金		167,370,468.66	157,518,878.18
存出保证金		20,099,313.19	42,201,974.48
交易性金融资产		22,597,153,372.44	18,411,742,931.07
其中: 股票投资		22,592,790,372.44	18,402,578,531.07
基金投资		-	-
债券投资		4,363,000.00	9,164,400.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	80,000,000.00
应收证券清算款		72,492,593.69	4,402,972.69
应收利息		112,471.97	126,568.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		22,910,182,189.83	18,714,002,429.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		69,323,223.80	4,307,720.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,008,002.51	7,928,154.27
应付托管费		2,001,600.53	1,585,630.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,048,511.72	626,392.65
应交税费		27.40	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		15,026,071.42	1,521,729.42
负债合计		99,407,437.38	15,969,627.59
所有者权益:			
实收基金		18,478,797,755.06	10,468,798,142.60
未分配利润		4,331,976,997.39	8,229,234,659.45
所有者权益合计		22,810,774,752.45	18,698,032,802.05
负债和所有者权益总计		22,910,182,189.83	18,714,002,429.64

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.0158 元，基金份额总额 7,563,849,828 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-5,054,637,920.37	3,775,378,294.27
1.利息收入		6,914,684.71	12,278,887.76
其中：存款利息收入		4,530,642.11	9,231,301.05
债券利息收入		13,487.37	29,582.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,370,555.23	3,018,004.71

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-216,594,398.33	497,334,508.13
其中：股票投资收益		-555,030,244.68	17,496,229.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,819,745.45	2,351,527.10
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-57,211,856.01	148,046,460.00
股利收益		393,827,956.91	329,440,291.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-4,835,169,586.16	3,264,998,138.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-9,788,620.59	766,760.17
减：二、费用		134,971,720.96	113,521,863.51
1.管理人报酬		97,972,971.42	86,510,108.60
2.托管费		19,594,594.29	17,302,021.73
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		8,964,539.61	4,276,406.60
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		30,734.43	-
7.其他费用		8,408,881.21	5,433,326.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,189,609,641.33	3,661,856,430.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,189,609,641.33	3,661,856,430.76

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	-	-5,189,609,641.33	-5,189,609,641.33
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	8,009,999,612.46	3,579,890,208.62	11,589,889,821.08

列)			
其中：1.基金申购款	9,845,945,173.17	4,355,087,862.55	14,201,033,035.72
2.基金赎回款	-1,835,945,560.71	-775,197,653.93	-2,611,143,214.64
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）	-	-2,287,538,229.35	-2,287,538,229.35
五、期末所有者权益（基金净值）	18,478,797,755.06	4,331,976,997.39	22,810,774,752.45
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	-	3,661,856,430.76	3,661,856,430.76
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）	-712,390,852.37	-396,348,925.21	-1,108,739,777.58
其中：1.基金申购款	156,110,341.16	118,702,022.79	274,812,363.95
2.基金赎回款	-868,501,193.53	-515,050,948.00	-1,383,552,141.53
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）	10,468,798,142.60	8,229,234,659.45	18,698,032,802.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 关联方关系

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
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

无。

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 债券交易

无。

7.4.4.1.4 债券回购交易

无。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	97,972,971.42	86,510,108.60
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

7.4.4.2.2 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12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	19,594,594.29	17,302,021.73

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 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	24,047,723.00	0.32%	4,936,560.00	0.12%
华夏沪深 300ETF 联接	4,014,259,256.00	53.07%	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。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31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	52,953,969.88	789,147.86	18,009,104.33	1,646,475.13

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。

7.4.4.6 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 12 月 31 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 12 月 31 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
中信证券	110042	航电转债	老股东优 先配售	11,260	1,126,000.00

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

7.4.4.7.1 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 3,943,895,700.00 元（上年度可比期间：8,447,323,800.00 元），支付给中信期货的佣金为 130,153.22 元（上年度可比期间：279,752.07 元）。

7.4.5 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603993	洛阳钼业	2018-11-29	2019-05-28	非公开发 行流通 受限	3.62	3.53	3,920,183	14,192,273.44	13,838,245.99	-
603799	华友	2018-08-28	2019-02-27	非公	46.84	28.69	200,000	9,368,000.00	5,738,000.00	-

	钴业			开发 行流 通受 限						
002602	世纪 华通	2018-12-05	2019-06-04	非公 开发 行流 通受 限	19.28	19.74	270,000	5,205,600.00	5,329,800.00	-
002555	三七 互娱	2018-12-03	2019-06-02	非公 开发 行流 通受 限	10.76	8.69	500,000	5,380,000.00	4,345,000.00	-
601860	紫金 银行	2019-12-20	2019-01-03	新发 流 通受 限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.5.1.2 受限证券类别：债券

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
110049	海 尔 转 债	2018-12-18	2019-01-18	新发 流 通 受 限	100.00	100.00	43,630	4,363,000.00	4,363,000.00	-

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

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

7.4.5.2 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
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项	4.87	2019-01-02	4.38	6,740,025	39,044,036.72	32,823,921.75	-
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项	16.01	2019-01-10	17.15	18,885,130	389,115,327.26	302,350,931.30	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	-	-	2,533,092	54,260,814.08	36,957,812.28	-

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。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.6.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非

活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至 2018 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 22,597,153,372.44 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。）

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的部分股票投资于 2017 年度转入第三层次，转入金额为 13,338,615.36 元，转入第三层次后的变动均为计入当期损益的未实现损失，计入利润表中的公允价值变动收益项目。该部分股票投资于 2018 年度转出第三层次，转出金额为 16,401,052.56 元，转出第三层次前的变动均为计入当期损益的未实现收益，计入利润表中的公允价值变动收益项目。

§8 投资组合报告

8.1 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	22,592,790,372.44	98.61
	其中：股票	22,592,790,372.44	98.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,363,000.00	0.02
	其中：债券	4,363,000.00	0.02
	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	220,324,438.54	0.96
8	其他各项资产	92,704,378.85	0.40
9	合计	22,910,182,189.83	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	43,079,575.00	0.19
B	采矿业	828,939,912.58	3.63
C	制造业	8,842,801,601.54	38.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	691,574,328.56	3.03
E	建筑业	885,172,876.97	3.88
F	批发和零售业	375,722,501.16	1.65
G	交通运输、仓储和邮政业	718,531,153.68	3.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	785,708,206.41	3.44
J	金融业	7,752,075,992.13	33.98
K	房地产业	1,110,419,680.30	4.87
L	租赁和商务服务业	280,235,199.92	1.23
M	科学研究和技术服务业	19,044,384.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	53,227,817.23	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	127,284,772.05	0.56
R	文化、体育和娱乐业	78,958,490.91	0.35
S	综合	-	-
	合计	22,592,776,492.44	99.04

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	25,981,331	1,457,552,669.10	6.39
2	600519	贵州茅台	1,202,389	709,421,533.89	3.11
3	600036	招商银行	24,738,212	623,402,942.40	2.73
4	601166	兴业银行	29,903,700	446,761,278.00	1.96
5	000651	格力电器	11,541,103	411,901,966.07	1.81

6	000333	美的集团	11,129,353	410,227,951.58	1.80
7	601328	交通银行	65,909,003	381,613,127.37	1.67
8	600016	民生银行	59,535,150	341,136,409.50	1.50
9	600887	伊利股份	14,582,292	333,642,840.96	1.46
10	601288	农业银行	91,894,925	330,821,730.00	1.45

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000651	格力电器	280,208,381.12	1.50
2	000333	美的集团	269,660,377.88	1.44
3	000002	万 科 A	172,149,499.43	0.92
4	000858	五 粮 液	169,263,405.82	0.91
5	002415	海康威视	153,685,862.37	0.82
6	000001	平安银行	127,045,300.24	0.68
7	000725	京东方 A	105,538,831.81	0.56
8	002304	洋河股份	100,110,264.36	0.54
9	603288	海天味业	99,187,024.63	0.53
10	002027	分众传媒	97,723,803.92	0.52
11	601229	上海银行	73,883,066.49	0.40
12	002594	比亚迪	67,304,278.26	0.36
13	002475	立讯精密	65,416,967.69	0.35
14	000661	长春高新	65,246,153.56	0.35
15	300408	三环集团	64,699,681.54	0.35
16	002024	苏宁易购	64,308,169.88	0.34
17	300059	东方财富	64,124,194.40	0.34
18	001979	招商蛇口	63,897,571.04	0.34
19	000063	中兴通讯	63,297,984.63	0.34
20	002142	宁波银行	61,704,471.14	0.33

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。

8.4.2 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	255,194,659.12	1.36
2	600519	贵州茅台	167,727,044.04	0.90

3	000651	格力电器	121,324,466.11	0.65
4	600016	民生银行	113,983,883.03	0.61
5	600036	招商银行	108,125,242.40	0.58
6	000333	美的集团	106,093,727.13	0.57
7	000002	万 科 A	78,658,184.86	0.42
8	601166	兴业银行	71,600,291.29	0.38
9	002415	海康威视	67,490,511.82	0.36
10	000858	五 粮 液	64,162,147.13	0.34
11	601328	交通银行	59,123,110.11	0.32
12	600887	伊利股份	55,229,157.94	0.30
13	000001	平安银行	54,400,665.87	0.29
14	600276	恒瑞医药	51,875,885.82	0.28
15	601288	农业银行	50,258,668.00	0.27
16	600030	中信证券	49,203,669.99	0.26
17	601099	太平洋	48,561,334.80	0.26
18	000725	京东方 A	46,332,209.00	0.25
19	600000	浦发银行	45,509,090.56	0.24
20	601668	中国建筑	43,438,406.36	0.23

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,757,842,996.43
卖出股票收入（成交）总额	5,239,608,802.02

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,363,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	4,363,000.00	0.02
----	----	--------------	------

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110049	海尔转债	43,630	4,363,000.00	0.02
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位:手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1901	沪深 300 股指期货股指期货 IF1901 合约	210	189,226,800.00	-8,498,640.00	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					-8,498,640.00
股指期货投资本期收益					-57,211,856.01
股指期货投资本期公允价值变动					-11,586,360.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	20,099,313.19
2	应收证券清算款	72,492,593.69
3	应收股利	-
4	应收利息	112,471.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,704,378.85

8.12.4 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。

8.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
7,999	945,599.43	3,391,538,113.00	44.84%	158,052,459.00	2.09%	4,014,259,256.00	53.07%

9.2 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	23.68%
2	中国人寿保险股份有限公司	379,057,100.00	5.01%
3	中国平安人寿保险股份有限公司一分红一个险分红	255,791,345.00	3.38%
4	中国平安人寿保险股份有限公司一万能一个险万能	203,887,618.00	2.70%
5	长城证券股份有限公司	183,900,900.00	2.43%
6	百年人寿保险股份有限公司一分红保险产品	95,183,800.00	1.26%
7	中国人民人寿保险股份有限公司一分红一个险分红	65,000,000.00	0.86%
8	方正证券股份有限公司	46,286,093.00	0.61%
9	西南证券股份有限公司	37,501,800.00	0.50%
10	五矿证券有限公司	31,000,000.00	0.41%
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	4,014,259,256.00	53.07%

9.3 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	-	-

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§10 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	4,030,200,000
减：本报告期基金总赎回份额	751,500,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,563,849,828

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 100,000.00 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 6 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	7,522,690,324.83	62.75%	987,913.11	39.09%	-
招商证券	2	3,112,140,077.80	25.96%	1,342,246.31	53.12%	-
中银国际证券	1	1,329,208,207.45	11.09%	174,527.97	6.91%	-
银河证券	4	23,560,273.44	0.20%	22,285.88	0.88%	-

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，本基金还选择了东北证券、方正证券、国泰君安证券、上海证券、天风证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、长江证券、中金公司、中泰证券、中投证券、中信建投证券、中信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，银河证券的部分交易单元，方正证券和招商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。

11.7.2 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	5,561,574.80	20.64%	9,718,000,000.00	97.98%
招商证券	-	-	200,000,000.00	2.02%
中银国际证券	21,387,367.87	79.36%	-	-
银河证券	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		的时间区 间					
机构	1	2018-01-01 至 2018-12-31	1,790,942,652.00	-	-	1,790,942,652.00	23.68%
华夏沪 深 300ETF 联接	1	2018-01-01 至 2018-12-31	2,420,278,422.00	1,906,305,734.00	312,324,900.00	4,014,259,256.00	53.07%

产品特有风险

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。

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。

华夏基金管理有限公司

二〇一九年三月二十六日