

# 华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

## 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年十月二十二日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
| 基金简称            | 华夏沪深 300 指数增强  |                  |
| 基金主代码           | 001015   |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式   |                  |
| 基金合同生效日         | 2015 年 2 月 10 日  |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 547,621,589.18 份   |                  |
| 投资目标            | 通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制, 力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上, 追求获得超越标的指数的回报。 |                  |
| 投资策略            | 本基金主要通过采取股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。                              |                  |
| 业绩比较基准          | 本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+1.5% (指年收益率, 评价时按期间折算)。                                 |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为股票指数增强型基金, 属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种, 其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。             |                  |
| 基金管理人           | 华夏基金管理有限公司   |                  |
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司   |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 华夏沪深 300 指数增强 A  | 华夏沪深 300 指数增强 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 001015   | 001016           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 374,033,519.56 份   | 173,588,069.62 份 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 |
|--------|-----|
|--------|-----|

|                 | (2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日) |                 |
|-----------------|----------------------------------|-----------------|
|                 | 华夏沪深 300 指数增强 A                  | 华夏沪深 300 指数增强 C |
| 1. 本期已实现收益      | 31,496,296.84                    | 12,806,663.45   |
| 2. 本期利润         | 9,513,816.04                     | 3,792,691.20    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0246                           | 0.0226          |
| 4. 期末基金资产净值     | 535,201,643.09                   | 242,655,036.50  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.431                            | 1.398           |

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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

##### 华夏沪深300指数增强A

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 1.56%      | 0.91%         | 0.10%          | 0.91%                 | 1.46% | 0.00% |

##### 华夏沪深300指数增强C

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 1.45%      | 0.91%         | 0.10%          | 0.91%                 | 1.35% | 0.00% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 指数增强型证券投资基金

##### 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

(2015 年 2 月 10 日至 2019 年 9 月 30 日)

##### 华夏沪深300指数增强A



华夏沪深300指数增强C



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明       |
|----|---------|-------------|------|--------|----------|
|    |         | 任职日期        | 离任日期 |        |          |
| 宋洋 | 本基金的基金经 | 2016-11-18  | -    | 9 年    | 中国科学院数学与 |

|  |           |  |  |  |
|--|-----------|--|--|--|
|  | 理、数量投资部总监 |  |  | 系统科学研究院博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员，华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 24 日至 2018 年 9 月 10 日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2018 年 4 月 10 日至 2019 年 2 月 26 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》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 公平交易专项说明

##### 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 1 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，为投资策略需要所致，该次交易基金经理已根据公司管理要求提

供决策依据。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 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,业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times 95\% + 1.5\%$ (指年收益率,评价时应按期间折算)。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。本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略,在严格控制跟踪误差的基础上,力求获得超越标的指数的超额收益。

3 季度,国际方面,全球经济延续 2019 年以来的弱势。8 月美国消费数据显露颓势,零售销售环比大幅回落,再叠加 8 月非农数据不及预期、投资端依然疲弱,加深了市场对美国经济下行的担忧;美联储于 8 月初、9 月中旬两次宣布下调联邦基金目标利率 25bp,全球经济体降息进程有所加快。欧元区经济依然偏弱,在全球贸易摩擦、英国脱欧前景不明等因素影响下,9 月制造业 PMI 数据全面不及预期。日本、德国、法国三个发达经济体自 3 季度以来 10 年期国债收益率集体持续为负,全市场负利率问题再次引发市场担忧。国内方面,经济依然面临下行压力。8 月工业增加值增速 4.4%,连续 2 个月下滑;1-8 月固定资产投资累计增速小幅下滑,主要受房地产和制造业的拖累,而基建投资增速出现反弹;消费端,8 月消费增速小幅回落,汽车消费依然是拖累的主要因素。

市场方面,3 季度 A 股市场整体呈现出 V 型反转走势。7 月初,沪深 300 指数在经历小幅反弹后再次进入下跌通道,并于 8 月上旬触及此轮调整的底部。随着中美贸易摩擦有所缓和,叠加 LPR 价格形成机制改革带来的实质性降息等一系列政策宽松利好,8 月以来沪深 300 指数持续回升。市场风格方面,创业板表现明显强于主板,TMT 板块全面爆发,电子、计算机、传媒、通信等行业涨幅居前。

基金投资运作方面,报告期内,本基金以多因子量化投资策略为主,在控制基金与标的指数跟踪偏离度的基础上,力争获取更高的超额收益。同时,本基金秉承尽职尽责的态度,应对投资者日常申购、赎回等可能对基金带来收益冲击的工作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 9 月 30 日,华夏沪深 300 指数增强 A 份额净值为 1.431 元,本报告期份额净值增长率为 1.56%,同期业绩比较基准增长率 0.10%,华夏沪深 300 指数增强 A 本报告期跟踪偏离度为 +1.46%;华夏沪深 300 指数增强 C 份额净值为 1.398 元,本报告期份额净值增长率为 1.45%,同期业绩比较基准增长率 0.10%,华夏沪深 300 指数增强 C 本报告期跟踪偏离度为 +1.35%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 734,662,199.82 | 92.34        |
|    | 其中：股票             | 734,662,199.82 | 92.34        |
| 2  | 固定收益投资            | 128,000.00     | 0.02         |
|    | 其中：债券             | 128,000.00     | 0.02         |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 47,694,062.77  | 5.99         |
| 7  | 其他资产              | 13,138,128.17  | 1.65         |
| 8  | 合计                | 795,622,390.76 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 5.2.1.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 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         | 10,604,578.00  | 1.36         |
| B  | 采矿业              | 11,190,654.00  | 1.44         |
| C  | 制造业              | 253,021,463.98 | 32.53        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 21,935,003.00  | 2.82         |



|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| E | 建筑业             | 24,004,948.80  | 3.09  |
| F | 批发和零售业          | 14,263,836.00  | 1.83  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 18,333,781.00  | 2.36  |
| H | 住宿和餐饮业          | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 21,837,884.00  | 2.81  |
| J | 金融业             | 252,931,418.42 | 32.52 |
| K | 房地产业            | 39,105,250.30  | 5.03  |
| L | 租赁和商务服务业        | 4,671,612.00   | 0.60  |
| M | 科学研究和技术服务业      | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -              | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -     |
| P | 教育              | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 818,642.00     | 0.11  |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 672,719,071.50 | 86.48 |

## 5.2.1.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

| 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         | 863,100.00    | 0.11         |
| B  | 采矿业              | 4,583,410.00  | 0.59         |
| C  | 制造业              | 28,818,296.53 | 3.70         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,139,240.40  | 0.28         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 8,715,816.00  | 1.12         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 10,640,030.39 | 1.37         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 21,960.00     | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |

|   |               |               |      |
|---|---------------|---------------|------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -             | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -    |
| P | 教育            | -             | -    |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 6,161,275.00  | 0.79 |
| S | 综合            | -             | -    |
|   | 合计            | 61,943,128.32 | 7.96 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 期末指数投资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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 629,062   | 54,753,556.48 | 7.04         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 38,546    | 44,327,900.00 | 5.70         |
| 3  | 000651 | 格力电器 | 415,852   | 23,828,319.60 | 3.06         |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 161,100   | 20,910,780.00 | 2.69         |
| 5  | 601328 | 交通银行 | 3,638,900 | 19,832,005.00 | 2.55         |
| 6  | 000002 | 万科 A | 714,977   | 18,517,904.30 | 2.38         |
| 7  | 002415 | 海康威视 | 565,000   | 18,249,500.00 | 2.35         |
| 8  | 600837 | 海通证券 | 1,157,700 | 16,555,110.00 | 2.13         |
| 9  | 601668 | 中国建筑 | 2,845,860 | 15,453,019.80 | 1.99         |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 443,600   | 15,415,100.00 | 1.98         |

#### 5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|--------------|
| 1  | 603659 | 璞泰来  | 108,300.00 | 5,544,960.00 | 0.71         |
| 2  | 300760 | 迈瑞医疗 | 23,800.00  | 4,390,148.00 | 0.56         |
| 3  | 300383 | 光环新网 | 230,900.00 | 4,290,122.00 | 0.55         |
| 4  | 603368 | 柳药股份 | 118,800.00 | 4,248,288.00 | 0.55         |
| 5  | 000301 | 东方盛虹 | 776,200.00 | 3,989,668.00 | 0.51         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 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） | 128,000.00 | 0.02 |
| 8  | 同业存单      | -          | -    |
| 9  | 其他        | -          | -    |
| 10 | 合计        | 128,000.00 | 0.02 |

## 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 128075 | 远东转债 | 1,280 | 128,000.00 | 0.02         |
| 2  | -      | -    | -     | -          | -            |
| 3  | -      | -    | -     | -          | -            |
| 4  | -      | -    | -     | -          | -            |
| 5  | -      | -    | -     | -          | -            |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 5.9.1 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（元）      | 公允价值变动（元）  | 风险说明           |
|--------|-------------|-----|--------------|------------|----------------|
| IF1911 | 沪深 300 股指期货 | 1   | 1,145,640.00 | -23,220.00 | 买入股指期货多头合约的目的是 |

|                   |           |  |  |  |               |
|-------------------|-----------|--|--|--|---------------|
|                   | IF1911 合约 |  |  |  | 进行更有效地流动性管理   |
| 公允价值变动总额合计（元）     |           |  |  |  | -23,220.00    |
| 股指期货投资本期收益（元）     |           |  |  |  | 2,493,995.43  |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |           |  |  |  | -1,300,055.29 |

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金，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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 265,201.69    |
| 2  | 应收证券清算款 | 10,836,674.78 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 11,450.00     |
| 5  | 应收申购款   | 2,024,801.70  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | -             |
| 9 | 合计 | 13,138,128.17 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 华夏沪深300指数增强A   | 华夏沪深300指数增强C   |
|--------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 372,727,454.63 | 156,508,032.77 |
| 报告期基金总申购份额   | 80,126,650.43  | 72,518,664.25  |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 78,820,585.50  | 55,438,627.40  |
| 报告期基金拆分变动份额  | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额  | 374,033,519.56 | 173,588,069.62 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

## 1、报告期内披露的主要事项

2019 年 7 月 12 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增联储证券有限责任公司为代销机构的公告。

2019 年 7 月 16 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增五矿证券有限公司为代销机构的公告。

2019 年 7 月 19 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中国人寿保险股份有限公司为代销机构的公告。

2019 年 7 月 31 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告。

2019 年 8 月 1 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构的公告。

2019 年 8 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增海银基金销售有限公司为代销机构的公告。

2019 年 8 月 19 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增万和证券股份有限公司为代销机构的公告。

2019 年 8 月 30 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告。

## 2、其他相关信息

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、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 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 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、5GETF、

华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏证券 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏豆粕 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、A 股市场指数、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至 2019 年 9 月 30 日数据），华夏移动互联混合(QDII)及华夏全球科技先锋混合(QDII)在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金(A 类)”中分别排序 2/33 和 7/33；华夏海外收益债券(QDII)(C 类)及华夏大中华信用债券(QDII)(C 类)在“QDII 基金-QDII 债券基金-QDII 债券型基金(非 A 类)”中分别排序 4/29 和 8/29；华夏鼎沛债券(A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级)(A 类)”中排序 2/225；华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金(二级)(A 类)”中排序 8/18；华夏债券(C 类)及华夏双债债券(C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债)(非 A 类)”分别排序 9/105 和 7/105；华夏聚利债券在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债)(A 类)”中排名 9/169；华夏医疗健康混合(C 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金(非 A 类)”中排序 4/19；华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 7/59；华夏消费 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”排序 4/31；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”排序 8/31；华夏创业板 ETF 联接(A 类)及华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接(A 类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)”中排序 5/46 和 9/46。

在客户服务方面，3 季度，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）直销电子交易平台开通华夏沃利货币 A 的快速赎回业务，华夏基金管家 APP、华夏基金微信公众号上线智能快取功能，满足了广大投资者对资金流动的迫切需求；（2）华夏基金净值服务全面升级为微信实时查看、订阅推送模式，方便客户及时、精准查询基金净值变动情况；（3）与万和证券、五矿证券、阳光人寿等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“微信全勤奖”、“户龄（第三期）”、“看谁能猜中”、“寻人启事”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

#### 9.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2 《华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》;

9.1.3 《华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》;

9.1.4 法律意见书;

9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

#### 9.2 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。

#### 9.3 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

二〇一九年十月二十二日