

**华夏沪深 300 交易型开放式指数
证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 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：二〇一九年八月二十九日

§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 2019 年 8 月 27 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 2019 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）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录.....	47

§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	6,945,549,828 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	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		杨明辉	陈四清

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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,311,867,246.36
本期利润	6,188,438,488.52
加权平均基金份额本期利润	0.8996
本期加权平均净值利润率	24.95%
本期基金份额净值增长率	27.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	9,836,466,315.61
期末可供分配基金份额利润	1.4162
期末基金资产净值	26,804,731,615.08
期末基金份额净值	3.8593
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	79.89%

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	6.06%	1.17%	5.39%	1.16%	0.67%	0.01%
过去三个月	-0.20%	1.53%	-1.21%	1.53%	1.01%	0.00%
过去六个月	27.97%	1.55%	27.07%	1.55%	0.90%	0.00%

过去一年	10.99%	1.53%	8.96%	1.53%	2.03%	0.00%
过去三年	28.42%	1.11%	21.30%	1.11%	7.12%	0.00%
自基金合同生效起至今	79.89%	1.51%	60.66%	1.52%	19.23%	-0.01%

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 2019 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、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, 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、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF 及华夏 3-5 年中高级可质押信用债 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、海外市场指数及信用债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 6 月 30 日数据), 华夏移动互联混合(QDII)在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金(A 类)”中排序 9/34; 华夏稳增混合在“混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金(A 类)”中排序 8/27; 华夏回报混合(H 类)在“混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金(非 A 类)”中排序 8/89; 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 1/228; 华夏理财 30 天债券(A 类)在“债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金(摊余成本法)(A 类)”中排序 10/40; 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 7/19; 华夏上证 50AH 优选指数(LOF)(A 类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(A 类)”中排序 8/29; 华夏上证 50AH 优选指数(LOF)(C 类)在“标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(非 A 类)”中排序 4/11; 华夏上证 50ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 6/61; 华夏消费 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中排序 3/31; 华夏沪深 300ETF 联接(C 类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金(非 A 类)”中排序 9/34。

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。在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上, 华夏安康债券、华夏收益债券(QDII)和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报 QDII 明星基金和 2018 年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中, 华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖, 华夏鼎茂债券(004042)荣获“2018 年度开放式债券型金牛基金”奖, 华夏中小板 ETF(159902)荣获“2018 年度开放式指数型金牛基金”奖。

在客户服务方面，2019 年上半年度，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）华夏基金客服电话系统上线智能语音功能，客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金信息，同时系统还可以进行身份信息认证，主动告知业务办理进度，为客户提供全面、准确、便捷的服务，提升客户体验；（2）直销电子交易平台开通华夏惠利货币 A 的快速赎回业务，为广大投资者的资金使用提供便利；（3）与微众银行、华融湘江银行、紫金农商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“你的今年收益知否？知否？”、“你的户口本更新了”、“户龄”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	-	19 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联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 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)、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）、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）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	-	11 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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

上半年，在中美贸易摩擦、技术紧张局势加剧和英国脱欧不确定性长期持续的背景下，全球经

济活动势头依旧疲弱。美国、日本等发达经济体增长表现超出预期，但新兴市场和发展中经济体的经济活动低于预期。国内方面，在国内外形势较复杂的情况下，经济增长保持了总体平稳、稳中有进的发展态势，主要宏观经济指标运行在合理区间，经济结构在优化调整。

市场方面，1 季度，政策环境转暖、外资等长期资金涌入等促使 A 股市场投资者情绪逐步高涨，推升市场反弹行情越走越高，各行业指数均录得正回报，估值低、弹性较大的中小盘风格指数补涨反弹势力最为强劲。2 季度，MSCI 提高 A 股因子由 5% 至 10%，借此机会北向资金加速流入 A 股进行布局，但由于中美贸易摩擦再起，上半年 A 股指数呈现先扬后抑的走势。

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、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、西部证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源股份有限公司、国泰君安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 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 3.8593 元，本报告期份额净值增长率为 27.97%，同期业绩比较基准增长率为 27.07%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.90%，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，外部环境仍较复杂，国内经济还有下行压力，但是经济平稳运行的基本面不会变，一系列逆周期调节的政策包括“六稳”政策逐步落地，效果将会继续显现，有利于实现全年经济社会发展的主要目标。

市场方面，目前 A 股估值处于合理水平，但部分上市公司盈利增速下滑尚未企稳，市场震荡企稳过程中，符合经济转型方向的板块已逐步迎来中长线投资窗口。此外，外资增配 A 股的整体大趋势不变，下半年更多的海外资金仍将持续流入 A 股市场，龙头中盘股受到边际增量资金推动效应将尤为明显，科创板的推出有望加速 A 股改革进程，实现科技、资本和实体经济的良性循环，对市场情绪起到持续提振效用。

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：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、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2019 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	121,638,111.20	52,953,969.88
结算备付金		108,955,835.42	167,370,468.66
存出保证金		13,086,774.73	20,099,313.19
交易性金融资产	6.4.7.2	26,608,018,297.21	22,597,153,372.44
其中：股票投资		26,608,018,297.21	22,592,790,372.44
基金投资		-	-
债券投资		-	4,363,000.00
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	30,000,000.00	-
应收证券清算款		116,191,518.34	72,492,593.69
应收利息	6.4.7.5	90,877.05	112,471.97
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		26,997,981,413.95	22,910,182,189.83

负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		142,998,857.83	69,323,223.80
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,327,878.11	10,008,002.51
应付托管费		2,065,575.61	2,001,600.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,316,314.15	3,048,511.72
应交税费		12,781.22	27.40
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	34,528,391.95	15,026,071.42
负债合计		193,249,798.87	99,407,437.38
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	16,968,265,299.47	18,478,797,755.06
未分配利润	6.4.7.10	9,836,466,315.61	4,331,976,997.39
所有者权益合计		26,804,731,615.08	22,810,774,752.45
负债和所有者权益总计		26,997,981,413.95	22,910,182,189.83

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.8593 元，基金份额总额 6,945,549,828 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		6,276,411,278.76	-2,254,079,019.73
1.利息收入		1,329,766.94	3,042,606.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,286,288.00	1,344,903.74
债券利息收入		5,643.72	10,687.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		37,835.22	1,687,015.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,396,092,094.41	58,356,852.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,087,299,454.03	-118,710,608.93

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,772,952.18	1,843,035.72
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	32,142,932.05	1,015,983.99
股利收益	6.4.7.17	272,876,756.15	174,208,441.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,876,571,242.16	-2,315,402,773.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	2,418,175.25	-75,706.04
减：二、费用		87,972,790.24	59,917,597.13
1.管理人报酬		61,433,738.08	45,760,405.46
2.托管费		12,286,747.57	9,152,081.09
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	10,331,386.80	2,108,247.39
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		96,444.99	30,725.93
7.其他费用	6.4.7.21	3,824,472.80	2,866,137.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,188,438,488.52	-2,313,996,616.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,188,438,488.52	-2,313,996,616.86

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	18,478,797,755.06	4,331,976,997.39	22,810,774,752.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,188,438,488.52	6,188,438,488.52
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）	-1,510,532,455.59	-683,949,170.30	-2,194,481,625.89
其中：1.基金申购款	6,932,618,385.68	3,433,500,298.51	10,366,118,684.19
2.基金赎回款	-8,443,150,841.27	-4,117,449,468.81	-12,560,600,310.08
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）	16,968,265,299.47	9,836,466,315.61	26,804,731,615.08
项目	上年度可比期间 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

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：朱威，会计机构负责人：朱威

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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。
- 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、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。
- 7、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。
- 8、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。
- 9、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。
- 10、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 2019 年 6 月 30 日	
	活期存款	121,638,111.20
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	121,638,111.20	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,595,527,266.00	26,608,018,297.21	3,012,491,031.21
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	23,595,527,266.00	26,608,018,297.21	3,012,491,031.21

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 2019 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	114,110,400.00	-	-	-
其中：股指期货	114,110,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	114,110,400.00	-	-	-

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
IF1907	沪深 300 股指期货 IF1907 合约	90	102,735,000.00	1,762,080.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IF1909	沪深 300 股指期货 IF1909 合约	10	11,375,400.00	675,660.00	买入股指期货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					2,437,740.00
股指期货投资本期收益					32,142,932.05
股指期货投资本期公允价值变动					10,936,380.00

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 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	30,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	30,000,000.00	-

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 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	24,730.36
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	58,574.89
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	6,817.80
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	754.00
合计	90,877.05

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 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,316,314.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,316,314.15

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应退替代款	32,381,567.79
应付指数使用费	1,879,431.77
预提费用	136,084.50
可退替代款	131,307.89
合计	34,528,391.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,563,849,828.00	18,478,797,755.06
本期申购	2,837,700,000.00	6,932,618,385.68
本期赎回（以“-”号填列）	-3,456,000,000.00	-8,443,150,841.27
本期末	6,945,549,828.00	16,968,265,299.47

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	16,751,242,114.10	-12,419,265,116.71	4,331,976,997.39
本期利润	1,311,867,246.36	4,876,571,242.16	6,188,438,488.52
本期基金份额交易产生的变动数	-1,289,246,170.61	605,297,000.31	-683,949,170.30
其中：基金申购款	6,590,526,092.93	-3,157,025,794.42	3,433,500,298.51
基金赎回款	-7,879,772,263.54	3,762,322,794.73	-4,117,449,468.81
本期已分配利润	0.00	-	-

本期末	16,773,863,189.85	-6,937,396,874.24	9,836,466,315.61
-----	-------------------	-------------------	------------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	337,071.61
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	935,177.15
其他	14,039.24
合计	1,286,288.00

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	314,569,253.95
股票投资收益——赎回差价收入	772,730,200.08
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	1,087,299,454.03

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,375,085,607.74
减：卖出股票成本总额	5,060,516,353.79
买卖股票差价收入	314,569,253.95

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	12,560,600,310.08
减：现金支付赎回款总额	3,953,453,843.08
减：赎回股票成本总额	7,834,416,266.92
赎回差价收入	772,730,200.08

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,786,225.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,007,200.00
减：应收利息总额	6,073.31
买卖债券差价收入	3,772,952.18

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 2019年1月1日至2019年6月30日
股指期货投资收益	32,142,932.05
合计	32,142,932.05

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	272,876,756.15
基金投资产生的股利收益	-
合计	272,876,756.15

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	4,865,634,862.16
——股票投资	4,865,634,862.16
——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	10,936,380.00
——权证投资	-
——期货投资	10,936,380.00
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	4,876,571,242.16

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,418,175.25
合计	2,418,175.25

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	10,331,386.80
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	10,331,386.80

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日

审计费用	49,588.57
信息披露费	56,743.15
指数使用费	3,686,024.22
上市费	29,752.78
银行费用	2,364.08
合计	3,824,472.80

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	61,433,738.08	45,760,405.46

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,286,747.57	9,152,081.09

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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	34,321,008.00	0.49%	24,047,723.00	0.32%
华夏沪深 300ETF 联接	4,005,552,611.00	57.67%	4,014,259,256.00	53.07%

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	121,638,111.20	337,071.61	31,619,059.57	212,507.57

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

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

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 1,651,294,080.00 元（上年度可比期间：1,974,396,120.00 元），支付给中信期货的佣金为 54,492.96 元（上年度可比期间：65,159.97 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（2019 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
000063	中兴通讯	2019-03-28	2019-09-28	非公开发行流	24.00	30.50	1,100,000	26,400,000.00	33,550,000.00	-

				通受限						
002027	分众传媒	2019-02-12	2019-08-12	非公开发 行流 通受 限	5.58	5.17	4,300,000	23,994,000.00	22,231,000.00	-
000100	TCL 集团	2019-03-19	2019-09-19	非公开发 行流 通受 限	3.38	3.22	5,500,000	18,590,000.00	17,710,000.00	-
600109	国金证 券	2019-04-17	2019-10-17	非公开发 行流 通受 限	10.26	9.14	1,200,000	12,312,000.00	10,968,000.00	-
300017	网宿科 技	2019-01-10	2019-07-10	非公开发 行流 通受 限	7.34	10.66	800,000	5,872,000.00	8,528,000.00	-
002555	三七互 娱	2019-06-13	2019-12-13	非公开发 行	11.21	12.57	580,000	6,501,800.00	7,290,600.00	-

				流通受限						
002411	延安必康	2019-04-23	2019-10-23	非公开发行 流通受限	17.45	16.71	150,000	2,617,500.00	2,506,500.00	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新发 流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

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
600485	*ST 信威	2016-12-26	重大事项	5.76	2019-07-12	13.86	2,533,092	54,260,814.08	14,590,609.92	-

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內。

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。

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，本基金所投资的证券均能及时变现。

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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

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。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 2019年6月30日		上年度末 2018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	26,608,021,276.44	99.27	22,592,790,372.44	99.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	26,608,021,276.44	99.27	22,592,790,372.44	99.04

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
+5%		1,390,324,661.86	1,134,722,896.46
-5%		-1,390,324,661.86	-1,134,722,896.46

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 26,490,646,566.52 元，第二层次的余额为 102,784,100.00 元，第三层次的余额为 14,590,609.92 元。（截至 2018 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

本基金持有的部分股票投资于本报告期转入第三层次，转入金额为 14,590,609.92 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。

§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	26,608,018,297.21	98.56
	其中：股票	26,608,018,297.21	98.56
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	30,000,000.00	0.11
	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	230,593,946.62	0.85
8	其他各项资产	129,369,170.12	0.48
9	合计	26,997,981,413.95	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	391,115,672.70	1.46
B	采矿业	855,953,619.12	3.19
C	制造业	10,583,597,328.55	39.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	603,257,762.97	2.25
E	建筑业	806,911,207.40	3.01
F	批发和零售业	362,580,025.52	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	816,408,170.40	3.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	963,423,725.67	3.59
J	金融业	9,329,236,114.17	34.80
K	房地产业	1,213,563,873.37	4.53
L	租赁和商务服务业	373,473,486.19	1.39
M	科学研究和技术服务业	19,173,616.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	31,581,205.30	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	132,182,296.72	0.49
R	文化、体育和娱乐业	125,563,172.36	0.47
S	综合	-	-
	合计	26,608,021,276.44	99.27

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	23,250,031	2,060,185,247.00	7.69
2	600519	贵州茅台	1,073,377	1,056,202,968.00	3.94
3	600036	招商银行	22,128,112	796,169,469.80	2.97
4	601166	兴业银行	31,207,600	570,787,004.00	2.13
5	000651	格力电器	10,324,915	567,870,325.00	2.12
6	000333	美的集团	9,927,143	514,821,636.00	1.92
7	000858	五粮液	4,160,607	490,743,595.70	1.83
8	600276	恒瑞医药	6,650,381	438,925,146.00	1.64
9	600887	伊利股份	13,087,703	437,260,157.20	1.63
10	600030	中信证券	16,895,730	402,287,331.30	1.50
11	601328	交通银行	58,982,403	360,972,306.40	1.35
12	600016	民生银行	53,281,650	338,338,477.50	1.26
13	601288	农业银行	82,234,625	296,044,650.00	1.10
14	600000	浦发银行	25,205,493	294,400,158.20	1.10
15	000002	万科A	10,429,377	290,040,974.40	1.08
16	300498	温氏股份	7,978,476	286,108,149.40	1.07
17	601398	工商银行	46,296,638	272,687,197.80	1.02
18	601668	中国建筑	45,050,194	259,038,615.50	0.97
19	000001	平安银行	18,429,219	253,954,637.80	0.95
20	600900	长江电力	14,161,803	253,496,273.70	0.95
21	600837	海通证券	17,373,464	246,529,454.20	0.92
22	601601	中国太保	6,750,344	246,455,059.40	0.92
23	002415	海康威视	8,021,121	221,222,517.20	0.83
24	600048	保利地产	15,321,144	195,497,797.40	0.73
25	600104	上汽集团	7,526,630	191,929,065.00	0.72
26	601169	北京银行	31,761,238	187,708,916.60	0.70
27	601888	中国国旅	2,099,164	186,090,888.60	0.69
28	603288	海天味业	1,735,586	182,236,530.00	0.68
29	600585	海螺水泥	4,298,343	178,381,234.50	0.67
30	601211	国泰君安	9,685,720	177,732,962.00	0.66
31	000725	京东方A	50,879,400	175,025,136.00	0.65
32	601688	华泰证券	7,814,205	174,413,055.60	0.65
33	600009	上海机场	2,072,207	173,609,502.50	0.65
34	601988	中国银行	45,231,452	169,165,630.50	0.63

35	601766	中国中车	20,886,383	168,970,838.50	0.63
36	600031	三一重工	12,579,700	164,542,476.00	0.61
37	000063	中兴通讯	5,098,629	163,625,401.40	0.61
38	002304	洋河股份	1,298,125	157,800,075.00	0.59
39	600028	中国石化	28,708,873	157,037,535.30	0.59
40	300059	东方财富	11,532,496	156,265,320.80	0.58
41	601088	中国神华	7,077,183	144,232,989.50	0.54
42	600309	万华化学	3,364,842	143,981,589.20	0.54
43	601229	上海银行	11,725,715	138,949,722.80	0.52
44	600690	青岛海尔	7,850,344	135,732,447.80	0.51
45	002142	宁波银行	5,586,748	135,422,771.50	0.51
46	002475	立讯精密	5,300,858	131,408,269.80	0.49
47	601818	光大银行	34,189,682	130,262,688.40	0.49
48	000568	泸州老窖	1,571,499	127,024,264.20	0.47
49	000338	潍柴动力	10,282,848	126,376,201.90	0.47
50	600340	华夏幸福	3,866,838	125,942,913.70	0.47
51	601012	隆基股份	5,444,708	125,827,201.90	0.47
52	600019	宝钢股份	19,128,597	124,335,880.50	0.46
53	600050	中国联通	19,989,600	123,135,936.00	0.46
54	601857	中国石油	17,381,802	119,586,797.80	0.45
55	002027	分众传媒	22,046,059	116,107,652.10	0.43
56	601989	中国重工	19,638,144	109,188,080.60	0.41
57	600919	江苏银行	14,864,200	107,914,092.00	0.40
58	601939	建设银行	14,418,815	107,275,983.60	0.40
59	001979	招商蛇口	5,094,995	106,485,395.50	0.40
60	601009	南京银行	12,737,899	105,215,045.70	0.39
61	002714	牧原股份	1,786,146	105,007,523.30	0.39
62	600999	招商证券	6,134,330	104,835,699.70	0.39
63	002230	科大讯飞	3,143,122	104,477,375.30	0.39
64	601390	中国中铁	16,004,709	104,350,702.70	0.39
65	601006	大秦铁路	12,770,300	103,311,727.00	0.39
66	600015	华夏银行	13,209,562	101,713,627.40	0.38
67	000661	长春高新	300,201	101,467,938.00	0.38
68	601628	中国人寿	3,580,481	101,399,221.90	0.38
69	002594	比亚迪	1,952,140	99,012,540.80	0.37
70	601336	新华保险	1,786,272	98,298,548.16	0.37
71	601186	中国铁建	9,879,050	98,296,547.50	0.37
72	601899	紫金矿业	25,989,100	97,978,907.00	0.37
73	000166	申万宏源	19,347,877	96,932,863.77	0.36
74	600570	恒生电子	1,381,947	94,179,688.05	0.35
75	000538	云南白药	1,111,762	92,743,186.04	0.35
76	002024	苏宁易购	7,988,715	91,710,448.20	0.34
77	600352	浙江龙盛	5,583,313	88,048,846.01	0.33

78	000776	广发证券	6,349,640	87,244,053.60	0.33
79	601669	中国电建	16,415,680	86,838,947.20	0.32
80	601933	永辉超市	8,221,560	83,942,127.60	0.31
81	300015	爱尔眼科	2,654,356	82,205,405.32	0.31
82	600958	东方证券	7,683,700	82,061,916.00	0.31
83	601225	陕西煤业	8,584,100	79,317,084.00	0.30
84	000876	新希望	4,526,550	78,626,173.50	0.29
85	601155	新城控股	1,944,000	77,390,640.00	0.29
86	000100	TCL 集团	23,264,879	76,867,047.07	0.29
87	600436	片仔癀	649,622	74,836,454.40	0.28
88	300142	沃森生物	2,634,476	74,713,739.36	0.28
89	600406	国电南瑞	3,966,530	73,936,119.20	0.28
90	002202	金风科技	5,930,939	73,721,571.77	0.28
91	600741	华域汽车	3,378,574	72,977,198.40	0.27
92	600588	用友网络	2,662,213	71,560,285.44	0.27
93	002736	国信证券	5,282,356	69,515,804.96	0.26
94	600660	福耀玻璃	3,010,831	68,436,188.63	0.26
95	601377	兴业证券	10,061,305	67,813,195.70	0.25
96	000157	中联重科	11,020,970	66,236,029.70	0.25
97	600010	包钢股份	39,142,025	66,150,022.25	0.25
98	600547	山东黄金	1,593,614	65,609,088.38	0.24
99	000783	长江证券	8,311,312	64,911,346.72	0.24
100	600795	国电电力	25,296,885	64,254,087.90	0.24
101	002008	大族激光	1,827,420	62,826,699.60	0.23
102	600705	中航资本	11,560,546	62,658,159.32	0.23
103	601901	方正证券	8,801,531	62,578,885.41	0.23
104	601111	中国国航	6,410,878	61,352,102.46	0.23
105	000069	华侨城 A	8,799,445	61,156,142.75	0.23
106	603993	洛阳钼业	15,171,920	60,080,803.20	0.22
107	600111	北方稀土	4,678,051	60,066,174.84	0.22
108	600703	三安光电	5,255,031	59,276,749.68	0.22
109	601108	财通证券	5,392,700	59,211,846.00	0.22
110	600011	华能国际	9,439,263	58,806,608.49	0.22
111	600438	通威股份	4,161,397	58,509,241.82	0.22
112	600089	特变电工	7,981,694	57,867,281.50	0.22
113	600383	金地集团	4,841,475	57,758,796.75	0.22
114	601800	中国交建	5,035,964	57,007,112.48	0.21
115	600029	南方航空	7,376,944	56,950,007.68	0.21
116	600886	国投电力	7,277,180	56,543,688.60	0.21
117	002236	大华股份	3,860,456	56,053,821.12	0.21
118	601985	中国核电	10,023,263	55,729,342.28	0.21
119	600271	航天信息	2,397,286	55,257,442.30	0.21
120	601600	中国铝业	14,033,846	55,012,676.32	0.21

121	002422	科伦药业	1,849,002	54,970,829.46	0.21
122	002007	华兰生物	1,802,437	54,956,304.13	0.21
123	600196	复星医药	2,160,877	54,670,188.10	0.20
124	600606	绿地控股	7,833,419	53,502,251.77	0.20
125	002001	新 和 成	2,772,600	53,483,454.00	0.20
126	000895	双汇发展	2,127,946	52,964,575.94	0.20
127	601555	东吴证券	5,155,672	52,845,638.00	0.20
128	300003	乐普医疗	2,294,840	52,827,216.80	0.20
129	600115	东方航空	8,422,500	52,809,075.00	0.20
130	002311	海大集团	1,694,453	52,358,597.70	0.20
131	600061	国投资本	3,633,220	50,901,412.20	0.19
132	600221	海航控股	24,696,100	50,133,083.00	0.19
133	002044	美年健康	4,017,435	49,976,891.40	0.19
134	600109	国金证券	5,196,811	49,817,002.92	0.19
135	600332	白云山	1,212,770	49,687,186.90	0.19
136	300124	汇川技术	2,143,306	49,103,140.46	0.18
137	000963	华东医药	1,872,283	48,604,466.68	0.18
138	000413	东旭光电	9,407,900	48,356,606.00	0.18
139	600522	中天科技	5,267,200	48,300,224.00	0.18
140	600487	亨通光电	2,864,120	48,002,651.20	0.18
141	600177	雅戈尔	7,536,789	47,858,610.15	0.18
142	601788	光大证券	4,186,600	47,810,972.00	0.18
143	002410	广联达	1,452,400	47,769,436.00	0.18
144	603019	中科曙光	1,355,940	47,593,494.00	0.18
145	600018	上港集团	6,962,517	47,484,365.94	0.18
146	000768	中航飞机	2,973,308	46,829,601.00	0.17
147	600637	东方明珠	4,424,461	46,633,818.94	0.17
148	601618	中国中冶	15,314,700	46,556,688.00	0.17
149	600100	同方股份	5,094,826	46,108,175.30	0.17
150	300033	同花顺	466,861	45,920,447.96	0.17
151	002352	顺丰控股	1,330,250	45,175,290.00	0.17
152	000425	徐工机械	10,087,712	44,991,195.52	0.17
153	601607	上海医药	2,473,800	44,899,470.00	0.17
154	300017	网宿科技	4,172,132	44,879,582.96	0.17
155	300122	智飞生物	1,025,874	44,215,169.40	0.16
156	600893	航发动力	1,938,156	44,015,522.76	0.16
157	300408	三环集团	2,246,146	43,687,539.70	0.16
158	002271	东方雨虹	1,915,210	43,398,658.60	0.16
159	600176	中国巨石	4,512,526	43,004,372.78	0.16
160	600516	方大炭素	3,474,140	42,697,180.60	0.16
161	601877	正泰电器	1,841,865	42,528,662.85	0.16
162	600498	烽火通信	1,505,776	41,950,919.36	0.16
163	601919	中远海控	8,313,127	41,731,897.54	0.16

164	300136	信维通信	1,672,966	40,904,018.70	0.15
165	601727	上海电气	7,569,416	40,723,458.08	0.15
166	600004	白云机场	2,222,400	40,447,680.00	0.15
167	600867	通化东宝	2,614,338	40,260,805.20	0.15
168	000728	国元证券	4,339,241	39,790,839.97	0.15
169	601998	中信银行	6,584,478	39,309,333.66	0.15
170	002460	赣锋锂业	1,672,900	39,196,047.00	0.15
171	600809	山西汾酒	564,800	38,999,440.00	0.15
172	000423	东阿阿胶	979,079	38,986,925.78	0.15
173	600023	浙能电力	8,753,350	38,689,807.00	0.14
174	600489	中金黄金	3,706,422	38,064,953.94	0.14
175	002673	西部证券	3,759,970	37,900,497.60	0.14
176	601018	宁波港	8,482,500	37,238,175.00	0.14
177	002466	天齐锂业	1,471,967	37,211,325.76	0.14
178	600066	宇通客车	2,855,289	37,175,862.78	0.14
179	002241	歌尔股份	4,173,764	37,104,761.96	0.14
180	600068	葛洲坝	5,934,445	36,971,592.35	0.14
181	002179	中航光电	1,097,790	36,732,053.40	0.14
182	600926	杭州银行	4,408,465	36,722,513.45	0.14
183	300144	宋城演艺	1,558,737	36,069,174.18	0.13
184	601997	贵阳银行	4,152,640	35,920,336.00	0.13
185	600170	上海建工	9,551,375	35,913,170.00	0.13
186	300024	机器人	2,343,807	35,696,180.61	0.13
187	002081	金螳螂	3,453,799	35,608,667.69	0.13
188	601021	春秋航空	786,956	35,413,020.00	0.13
189	601198	东兴证券	2,962,100	35,189,748.00	0.13
190	600362	江西铜业	2,228,669	35,079,250.06	0.13
191	002146	荣盛发展	3,735,392	35,075,330.88	0.13
192	600398	海澜之家	3,857,422	34,986,817.54	0.13
193	600482	中国动力	1,474,500	34,827,690.00	0.13
194	600219	南山铝业	15,391,370	34,784,496.20	0.13
195	002602	世纪华通	3,178,471	34,708,903.32	0.13
196	000961	中南建设	3,979,350	34,461,171.00	0.13
197	600085	同仁堂	1,183,697	34,327,213.00	0.13
198	601838	成都银行	3,876,400	34,228,612.00	0.13
199	601881	中国银河	2,759,300	33,801,425.00	0.13
200	600674	川投能源	3,780,930	33,650,277.00	0.13
201	603156	养元饮品	903,159	33,489,135.72	0.12
202	000630	铜陵有色	13,549,352	33,331,405.92	0.12
203	000703	恒逸石化	2,437,689	33,298,831.74	0.12
204	002739	万达电影	1,780,400	32,830,576.00	0.12
205	000786	北新建材	1,808,600	32,789,918.00	0.12
206	002493	荣盛石化	2,694,175	32,491,750.50	0.12

207	603986	兆易创新	373,800	32,408,460.00	0.12
208	600535	天士力	1,941,281	32,128,200.55	0.12
209	002456	欧菲光	4,072,415	31,927,733.60	0.12
210	300070	碧水源	4,054,070	31,581,205.30	0.12
211	002050	三花智控	2,970,164	31,335,230.20	0.12
212	600297	广汇汽车	7,024,040	31,327,218.40	0.12
213	000629	攀钢钒钛	9,219,400	31,253,766.00	0.12
214	601138	工业富联	2,551,600	30,746,780.00	0.11
215	002555	三七互娱	2,281,095	30,340,437.25	0.11
216	603833	欧派家居	279,064	30,032,867.68	0.11
217	600369	西南证券	6,060,458	29,938,662.52	0.11
218	300296	利亚德	3,821,300	29,920,779.00	0.11
219	603799	华友钴业	1,391,841	29,660,131.71	0.11
220	600663	陆家嘴	1,883,100	29,188,050.00	0.11
221	600208	新湖中宝	9,229,553	28,980,796.42	0.11
222	002624	完美世界	1,122,800	28,979,468.00	0.11
223	000596	古井贡酒	242,799	28,774,109.49	0.11
224	600118	中国卫星	1,273,691	28,721,732.05	0.11
225	002065	东华软件	4,009,748	28,028,138.52	0.10
226	000625	长安汽车	4,180,700	27,718,041.00	0.10
227	000656	金科股份	4,585,300	27,649,359.00	0.10
228	600346	恒力石化	2,267,139	27,568,410.24	0.10
229	002508	老板电器	1,014,278	27,527,504.92	0.10
230	000627	天茂集团	4,235,400	27,487,746.00	0.10
231	002032	苏泊尔	359,658	27,272,866.14	0.10
232	000709	河钢股份	9,119,300	27,266,707.00	0.10
233	600153	建发股份	3,043,505	27,026,324.40	0.10
234	601992	金隅集团	7,155,100	26,903,176.00	0.10
235	603160	汇顶科技	192,400	26,705,120.00	0.10
236	601878	浙商证券	2,865,700	26,651,010.00	0.10
237	600583	海油工程	4,743,100	26,561,360.00	0.10
238	600027	华电国际	6,992,900	26,363,233.00	0.10
239	600760	中航沈飞	899,500	26,112,485.00	0.10
240	600038	中直股份	635,029	26,048,889.58	0.10
241	601117	中国化学	4,242,100	25,537,442.00	0.10
242	600977	中国电影	1,601,973	25,086,897.18	0.09
243	002153	石基信息	688,918	24,931,942.42	0.09
244	603858	步长制药	948,200	24,435,114.00	0.09
245	600688	上海石化	4,717,766	24,343,672.56	0.09
246	600415	小商品城	5,847,404	24,091,304.48	0.09
247	601216	君正集团	7,238,666	23,815,211.14	0.09
248	002558	巨人网络	1,307,677	23,760,491.09	0.09
249	600816	安信信托	4,694,525	23,707,351.25	0.09

250	000671	阳光城	3,470,700	22,490,136.00	0.08
251	002252	上海莱士	3,201,302	22,249,048.90	0.08
252	601238	广汽集团	1,996,760	21,824,586.80	0.08
253	601319	中国人保	2,286,300	21,696,987.00	0.08
254	601633	长城汽车	2,583,012	21,361,509.24	0.08
255	600566	济川药业	700,856	21,102,774.16	0.08
256	002010	传化智联	2,802,000	21,099,060.00	0.08
257	600188	兖州煤业	1,913,002	20,794,331.74	0.08
258	002310	东方园林	3,465,287	20,791,722.00	0.08
259	601066	中信建投	956,200	20,156,696.00	0.08
260	000402	金融街	2,561,927	20,085,507.68	0.07
261	600704	物产中大	3,700,320	20,055,734.40	0.07
262	002294	信立泰	895,988	20,052,211.44	0.07
263	300072	三聚环保	2,519,095	19,976,423.35	0.07
264	000898	鞍钢股份	5,151,690	19,524,905.10	0.07
265	002601	龙蟠佰利	1,312,500	19,464,375.00	0.07
266	002120	韵达股份	623,830	19,226,440.60	0.07
267	603259	药明康德	221,200	19,173,616.00	0.07
268	601898	中煤能源	3,927,700	18,852,960.00	0.07
269	300413	芒果超媒	455,100	18,681,855.00	0.07
270	002773	康弘药业	567,379	18,678,116.68	0.07
271	601360	三六零	869,300	18,585,634.00	0.07
272	002411	延安必康	983,081	17,002,109.40	0.06
273	000938	紫光股份	616,548	16,800,933.00	0.06
274	600372	中航电子	1,126,864	16,722,661.76	0.06
275	601228	广州港	3,985,300	16,658,554.00	0.06
276	002468	申通快递	659,107	16,438,128.58	0.06
277	002938	鹏鼎控股	549,600	16,136,256.00	0.06
278	600025	华能水电	3,863,500	15,724,445.00	0.06
279	000415	渤海租赁	3,980,300	15,602,776.00	0.06
280	600339	中油工程	3,599,600	15,190,312.00	0.06
281	600998	九州通	1,214,744	15,014,235.84	0.06
282	600485	*ST 信威	2,533,092	14,590,609.92	0.05
283	300251	光线传媒	1,896,275	12,894,670.00	0.05
284	601808	中海油服	1,275,500	12,283,065.00	0.05
285	002939	长城证券	733,400	12,240,446.00	0.05
286	601162	天风证券	1,106,100	11,990,124.00	0.04
287	002925	盈趣科技	303,334	11,833,059.34	0.04
288	300433	蓝思科技	1,683,279	11,732,454.63	0.04
289	002945	华林证券	582,800	10,781,800.00	0.04
290	000408	藏格控股	1,288,300	10,654,241.00	0.04
291	600390	五矿资本	1,120,400	10,565,372.00	0.04
292	601828	美凯龙	862,700	10,481,805.00	0.04

293	000553	安道麦 A	975,100	10,453,072.00	0.04
294	603260	合盛硅业	212,100	9,981,426.00	0.04
295	600233	圆通速递	788,958	9,727,852.14	0.04
296	601298	青岛港	1,037,100	8,701,269.00	0.03
297	002625	光启技术	922,350	8,568,631.50	0.03
298	601212	白银有色	1,852,400	8,132,036.00	0.03
299	601577	长沙银行	807,200	7,700,688.00	0.03
300	600733	北汽蓝谷	897,700	7,415,002.00	0.03
301	600299	安迪苏	635,600	6,591,172.00	0.02
302	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.00
303	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
304	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
305	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
306	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
307	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
308	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00

注：报告期内“中信证券”系投资人申购交付组合证券被动持有。

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	300498	温氏股份	319,314,636.61	1.40
2	000651	格力电器	227,988,342.79	1.00
3	000333	美的集团	206,789,799.32	0.91
4	000858	五粮液	167,914,667.95	0.74
5	000002	万科 A	125,745,453.52	0.55
6	000661	长春高新	121,439,036.98	0.53
7	002415	海康威视	102,385,226.50	0.45
8	000001	平安银行	97,604,426.12	0.43
9	002027	分众传媒	96,528,409.13	0.42
10	000063	中兴通讯	90,540,889.49	0.40
11	300059	东方财富	80,678,109.32	0.35
12	002304	洋河股份	77,733,676.27	0.34
13	000725	京东方 A	74,440,627.00	0.33
14	601166	兴业银行	69,250,814.73	0.30
15	002714	牧原股份	60,934,302.56	0.27
16	600519	贵州茅台	58,418,824.77	0.26
17	002594	比亚迪	53,273,708.79	0.23
18	601088	中国神华	52,184,954.88	0.23
19	000166	申万宏源	52,169,629.08	0.23

20	000100	TCL 集团	51,631,001.49	0.23
----	--------	--------	---------------	------

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	000651	格力电器	277,098,541.28	1.21
2	000333	美的集团	261,600,241.03	1.15
3	000858	五粮液	199,085,600.87	0.87
4	000002	万科 A	160,428,176.81	0.70
5	002415	海康威视	133,619,023.38	0.59
6	000001	平安银行	122,660,241.00	0.54
7	000661	长春高新	121,084,697.31	0.53
8	000063	中兴通讯	111,628,151.00	0.49
9	600519	贵州茅台	105,464,862.97	0.46
10	000725	京东方 A	99,962,587.81	0.44
11	002304	洋河股份	93,488,511.99	0.41
12	002027	分众传媒	79,115,292.83	0.35
13	300059	东方财富	68,877,516.47	0.30
14	601318	中国平安	68,383,306.56	0.30
15	002594	比亚迪	64,410,543.16	0.28
16	000100	TCL 集团	64,159,200.00	0.28
17	000338	潍柴动力	63,508,864.28	0.28
18	002475	立讯精密	60,828,034.22	0.27
19	001979	招商蛇口	60,602,879.50	0.27
20	002142	宁波银行	60,368,322.65	0.26

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	5,000,360,256.25
卖出股票的收入（成交）总额	5,375,085,607.74

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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1907	沪深 300 股指期货 IF1907 合约	90	102,735,000.00	1,762,080.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IF1909	沪深 300 股指期货 IF1909 合约	10	11,375,400.00	675,660.00	买入股指期货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					2,437,740.00
股指期货投资本期收益					32,142,932.05
股指期货投资本期公允价值变动					10,936,380.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,086,774.73
2	应收证券清算款	116,191,518.34
3	应收股利	-
4	应收利息	90,877.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	129,369,170.12

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		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
10,288	675,111.76	2,722,102,763.00	39.19%	217,894,454.00	3.14%	4,005,552,611.00	57.67%

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	25.79%
2	中国人寿保险股份有限公司	189,916,581.00	2.73%
3	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	169,783,145.00	2.44%
4	中国平安人寿保险股份有限公司—万能—一个险万能	143,887,618.00	2.07%
5	中国人寿再保险有限责任公司	38,249,300.00	0.55%
6	中信证券股份有限公司	34,321,008.00	0.49%
7	中国人寿保险（集团）公司	25,400,000.00	0.37%
8	国泰君安证券股份有限公司	24,697,713.00	0.36%
9	中国大地财产保险股份有限公司	24,146,400.00	0.35%
10	黄秀芬	21,242,600.00	0.31%
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	4,005,552,611.00	57.67%

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	7,563,849,828
本报告期基金总申购份额	2,837,700,000
减：本报告期基金总赎回份额	3,456,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,945,549,828

§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 2019 年 3 月 2 日发布公告，李彬女士担任华夏基金管理有限公司督察长，周璇女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

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	

银河证券	4	5,140,633,045.48	49.61%	2,223,503.66	55.82%	-
联讯证券	1	2,647,826,822.51	25.55%	1,142,014.88	28.67%	-
国金证券	3	1,643,600,525.24	15.86%	217,041.26	5.45%	-
招商证券	2	848,035,159.10	8.18%	365,762.05	9.18%	-
中金公司	2	81,209,403.27	0.78%	35,026.01	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、东方证券、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、长城证券、长江证券、中泰证券、中投证券、中信建投证券、中信证券、中银国际的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，中金公司的部分交易单元，联讯证券、长城证券、东方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
银河证券	31,550,669.95	90.70%	75,000,000.00	71.43%
联讯证券	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-
招商证券	2,630,278.64	7.56%	-	-
中金公司	605,276.90	1.74%	30,000,000.00	28.57%

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华夏沪深 300ETF、华夏中证 500ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-15
2	华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300ETF、华夏中证 500ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-21
3	华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300ETF、华夏中证 500ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-02-20
4	华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300ETF、华夏中证 500ETF、华夏中证央企 ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-02-25
5	华夏基金管理有限公司关于旗下华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 所持停牌股票“信威集团”估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-01
6	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-02
7	华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300ETF、华夏中证 500ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-13
8	华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-04
9	华夏基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-15
10	华夏基金管理有限公司关于提示投资者在中国结算办理场内外账户对应关系维护业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09
11	华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300ETF、华夏中证 500ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-21
12	华夏基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善客户身份信息资料的特别提示公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-04

§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	持有基金	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

	号	份额比例达到或者超过 20% 的时间区间					比
机构	1	2019-01-01 至 2019-06-30	1,790,942,652.00	-	-	1,790,942,652.00	25.79%
华夏沪深 300ETF 联接	1	2019-01-01 至 2019-06-30	4,014,259,256.00	1,453,741,049.00	1,462,447,694.00	4,005,552,611.00	57.67%
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

二〇一九年八月二十九日