

**MSCI 中国 A 股交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金  
2016 年半年度报告**

**2016 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 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.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§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.....	15
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末投资目标基金明细.....	31
7.3 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.4 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
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.8 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.....	47
7.9 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.....	47
7.10 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.....	47
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.13 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49
§11 备查文件目录.....	52

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	华夏MSCI中国A股ETF联接
基金主代码	000975
交易代码	000975
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月12日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	115,056,258.44份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 12 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 3 月 25 日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对目标 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标，基金还将投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生工具，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回以及股指期货之间的投资操作，以及目标 ETF

	的合并分拆，以增强基金收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

### 2.2.1 目标基金产品说明

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，以期获得与标的指数收益相似的回报。
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 MSCI 中国 A 股指数。
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	王永民
	联系电话	400-818-6666	010-66594896
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	田国立

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

### §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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-1,880,596.22
本期利润	-17,372,821.41
加权平均基金份额本期利润	-0.1474
本期加权平均净值利润率	-17.05%
本期基金份额净值增长率	-14.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016年6月30日）
期末可供分配利润	-13,158,358.24
期末可供分配基金份额利润	-0.1144
期末基金资产净值	101,897,900.20
期末基金份额净值	0.886
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016年6月30日）
基金份额累计净值增长率	-11.40%

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	1.49%	1.02%	0.97%	1.05%	0.52%	-0.03%
过去三个月	-0.23%	1.11%	-1.73%	1.11%	1.50%	0.00%
过去六个月	-14.31%	1.86%	-16.70%	1.94%	2.39%	-0.08%
过去一年	-27.79%	2.21%	-29.88%	2.29%	2.09%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-11.40%	2.18%	-6.70%	2.26%	-4.70%	-0.08%

##### 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

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 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

(2015 年 2 月 12 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：根据 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

## §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，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 10 只 ETF 产品，分别为华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中证 500ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏恒生 ETF 和华夏沪港通恒生 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的 ETF 产品线。

在《中国证券报》主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2015 年度被动投资金牛基金公司”奖。在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中，华夏基金获得“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”奖。

在客户服务方面，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）实现资产证明和对账单自动获取，客户可以自助提交申请并查询办理进度，业务处理更加高效；（2）网上交易平台上线交通银行、招商银行、民生银行、邮政储蓄银行等快捷支付方式和华夏财富系统，并与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财，拓宽客户交易通道，增加交易便利性；（3）开展“130 万人定投的华夏红利”、“客户个性化白皮书”、“你定，我投”、“书写华夏印象，见证一个行业”等活动，为客户提供多样化的关怀服务。

#### 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		
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部董事总经理	2015-02-12	-	16 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等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为 MSCI 中国 A 股指数，业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股指数收益率  $\times 95\%$  + 人民币活期存款税后利率  $\times 5\%$ 。MSCI 中国 A 股指数是国际指数公司 MSCI 为中国 A 股市场创建的独立国家指数，旨在为当前投资 A 股市场的广大投资者提供一个股票表现基准，该指数力图反映国内 A 股投资者的投资过程和制约因素，同时也可成为国际投资者了解和参与中国 A 股市场的一个工具。该指数自 2005 年 5 月起正式发布，以 A 股沪深两市大中盘股票为成份股样本，以其经调整的自由流通市值为权数计算得到；截至 2016 年 6 月 30 日，该指数成份股样本共计 813 只。本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF（MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金），从而实现基金投资目标，基金也可以通过买入 MSCI 中国 A 股指数成份股来跟踪标的指数。

上半年，国际方面，美国经济温和复苏，但由于就业改善放缓、通胀不达长期目标，以及外部不确定因素影响，美联储维持基准利率不变；日本 1 季度意外实施负利率；欧洲货币政策也较为宽松，英国脱欧公投及后续影响成为报告期内的重大不确定因素。国内方面，在供给侧结构性改革不断推进以及稳增长政策效应持续释放的共同作用下，上半年经济运行整体平稳，对经济发展新常态的认识

也不不断深化，但经济增长压力、结构转型压力依然较大。报告期内，货币政策维持宽松，市场对通胀的担忧逐渐缓减。

市场方面，年初以来，受人民币短期快速贬值、资本流出压力加剧及相关监管措施实施等诸多因素影响，A 股经历了一波较大幅度的调整。之后随着人民币逐步企稳、市场监管措施调整及美元暂缓加息等因素影响，A 股逐渐企稳，并在一系列国际国内因素影响下维持震荡。

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、赎回等工作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.886 元，本报告期份额净值增长率为-14.31%，同期业绩比较基准增长率为-16.70%。本基金本报告期跟踪偏离度为+2.39%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国际方面，美元的加息节奏仍是牵动市场神经的重要因素，同时英国脱欧谈判启动及后续风险以及全球民粹主义抬头、地缘政治风险发酵也是需要关注的因素。国内方面，经济仍面临较大的挑战，政府将切实推进供给侧结构性改革，一些实质性的改革举措或将陆续落地；财政政策料将积极有为，货币政策也会维持稳健。如果经济企稳或有超预期的改革举措，MSCI 中国 A 股指数将会有较好的投资机会；反之，则可能呈震荡走势。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，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，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。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模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务

会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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：MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,393,978.17	6,253,643.59
结算备付金		739,503.75	45,799.85
存出保证金		9,664.49	217,805.79
交易性金融资产	6.4.7.2	96,589,515.35	114,617,254.37
其中：股票投资		2,814,026.34	1,476,568.50
基金投资		93,763,357.11	113,126,403.47
债券投资		12,131.90	14,282.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,406.91	1,404.22
应收股利		-	-
应收申购款		18,506.40	12,530.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	46,231.10	32,407.31
资产总计		102,798,806.17	121,180,845.98
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		366,061.99	-
应付赎回款		466,144.59	200,631.21
应付管理人报酬		2,926.13	4,080.30
应付托管费		585.23	816.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,913.24	21,440.42
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	61,274.79	110,756.14
负债合计		900,905.97	337,724.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	115,056,258.44	116,845,318.50
未分配利润	6.4.7.10	-13,158,358.24	3,997,803.33
所有者权益合计		101,897,900.20	120,843,121.83
负债和所有者权益总计		102,798,806.17	121,180,845.98

注：①报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.886 元，基金份额总额 115,056,258.44 份。

②本基金合同于 2015 年 2 月 12 日生效，上年度可比期间自 2015 年 2 月 12 日至 2015 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日 (基金合同生效 日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-17,277,833.06	124,038,466.93
1.利息收入		33,488.12	533,419.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	32,982.65	371,106.99
债券利息收入		14.50	0.92
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		490.97	162,311.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,837,653.96	77,978,739.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-120,677.40	14,198,333.26
基金投资收益	6.4.7.13	-2,030,888.15	64,679,532.58
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	304,730.00	-940,813.00
股利收益	6.4.7.18	9,181.59	41,686.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-15,492,225.19	44,709,508.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	18,557.97	816,799.02
<b>减：二、费用</b>		94,988.35	816,267.31
1.管理人报酬		20,147.88	281,904.97
2.托管费		4,029.61	56,380.98
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.21	9,644.79	417,957.94
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.22	61,166.07	60,023.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-17,372,821.41	123,222,199.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-17,372,821.41	123,222,199.62

注：本基金合同于 2015 年 2 月 12 日生效，上年度可比期间自 2015 年 2 月 12 日至 2015 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	116,845,318.50	3,997,803.33	120,843,121.83

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-17,372,821.41	-17,372,821.41
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）	-1,789,060.06	216,659.84	-1,572,400.22
其中：1.基金申购款	22,856,774.22	-3,273,629.63	19,583,144.59
2.基金赎回款	-24,645,834.28	3,490,289.47	-21,155,544.81
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）	115,056,258.44	-13,158,358.24	101,897,900.20
项目	上年度可比期间 2015年2月12日（基金合同生效日）至2015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）	595,618,957.58	-	595,618,957.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	123,222,199.62	123,222,199.62
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）	-384,681,873.59	-75,380,012.84	-460,061,886.43
其中：1.基金申购款	153,941,157.38	39,425,508.53	193,366,665.91
2.基金赎回款	-538,623,030.97	-114,805,521.37	-653,428,552.34
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）	210,937,083.99	47,842,186.78	258,779,270.77

注：本基金合同于 2015 年 2 月 12 日生效，上年度可比期间自 2015 年 2 月 12 日至 2015 年 6 月 30 日。

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：

杨明辉	汪贵华	汪贵华
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]870号《关于准予 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 1 月 21 日至 2015 年 2 月 10 日期间共募集 595,482,646.12 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0146 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于 2015 年 2 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 595,618,957.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 136,311.46 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《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合同》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、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（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、国债期货、货币市场工具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（但须符合中国证监会相关规定）。

### 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。

#### 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局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》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营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- 3、存款利息收入不征收增值税。

4、国债、地方政府债及政策性金融债券利息收入、质押式买入返售金融商品利息收入、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税。

5、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、利息收入时代扣代缴 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，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。

6、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。

7、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。

#### 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	5,393,978.17
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,393,978.17

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,788,332.06	2,814,026.34	25,694.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,000.00	12,131.90
	银行间市场	-	-
	合计	11,000.00	12,131.90
资产支持证券	-	-	-

基金	105,562,046.78	93,763,357.11	-11,798,689.67
其他	-	-	-
合计	108,361,378.84	96,589,515.35	-11,771,863.49

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,095.48
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	304.74
应收债券利息	2.29
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.40
合计	1,406.91

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
应收退补款	22,814.70
可收退补款	23,416.40
合计	46,231.10

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,913.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,913.24

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,602.45
预提费用	59,672.34
合计	61,274.79

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	116,845,318.50	116,845,318.50
本期申购	22,856,774.22	22,856,774.22
本期赎回（以“-”号填列）	-24,645,834.28	-24,645,834.28
本期末	115,056,258.44	115,056,258.44

## 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	27,623,726.21	-23,625,922.88	3,997,803.33
本期利润	-1,880,596.22	-15,492,225.19	-17,372,821.41
本期基金份额交易产生的变动数	-407,395.98	624,055.82	216,659.84
其中：基金申购款	5,328,586.27	-8,602,215.90	-3,273,629.63
基金赎回款	-5,735,982.25	9,226,271.72	3,490,289.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,335,734.01	-38,494,092.25	-13,158,358.24

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,573.11
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	12,041.42
其他	368.12
合计	32,982.65

## 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-57,567.16
股票投资收益——赎回差价 收入	-
股票投资收益——申购差价 收入	-63,110.24
合计	-120,677.40

## 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,364,068.30
减：卖出股票成本总额	3,421,635.46
买卖股票差价收入	-57,567.16

## 6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	4,535,000.00
减：现金支付申购款总额	1,883,583.70
减：申购股票成本总额	2,714,526.54
申购差价收入	-63,110.24

## 6.4.7.12.4 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无股票投资收益——赎回差价收入。

## 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	13,784,385.44
减：卖出/赎回基金成本总额	15,815,273.59
基金投资收益	-2,030,888.15

## 6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

## 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.16 贵金属投资收益

## 6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

## 6.4.7.16.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

## 6.4.7.16.3 贵金属投资——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

## 6.4.7.16.4 贵金属投资——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

## 6.4.7.17 衍生工具收益

## 6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

## 6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	304,730.00
合计	304,730.00

## 6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,181.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,181.59

## 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-15,492,225.19
——股票投资	-63,859.17
——债券投资	-2,150.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-15,426,215.52
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-15,492,225.19

## 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	18,557.97
合计	18,557.97

## 6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	9,644.79
银行间市场交易费用	-
合计	9,644.79

## 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
银行费用	1,293.73
其他	200.00
合计	61,166.07

#### 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信期货有限公司(“中信期货”)	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金(“目标 ETF”)	本基金是该基金的联接基金

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 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 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年2月12日（基金合同 生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,147.88	281,904.97
其中：支付销售机构的客户维护费	75,958.24	318,515.66

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扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.5%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=(前一日的基金资产净值 - 前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值)×0.5%/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

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

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年2月12日（基金合同生 效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的 托管费	4,029.61	56,380.98

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扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 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=(前一日的基金资产净值 - 前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值) × 0.1%/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资

产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 2016年1月1日至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年2月12日(基金合同生效日) 至2015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
中国银行活期存款	5,393,978.17	20,573.11	19,168,812.29	319,145.47

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
中信证券股份有限公司	600489	中金黄金	老股东配售	36	223.92
上年度可比期间 2015年2月12日(基金合同生效日)至2015年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
中信证券股	-	-	-	-	-

份有限公司					
-------	--	--	--	--	--

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

截至 2015 年 6 月 30 日止,本基金持有目标 ETF 基金份额 101,772,883 份(2015 年 12 月 31 日: 103,804,738 份), 占其总份额的比例为 25.54%(2015 年 12 月 31 日: 21.25%); 本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 0 元(上年度可比期间: 105,922,453.00 元), 支付给中信期货的佣金为 0 元(上年度可比期间: 3,578.25 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(2016 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
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新发流通受限	8.49	8.49	1,000	8,490.00	8,490.00	-

## 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600649	城投控股	2016-06-20	重大事项	14.36	-	-	500	7,180.00	7,180.00	-
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项	4.90	-	-	1,400	6,972.00	6,860.00	-
000002	万科 A	2015-12-21	重大事项	18.20	2016-07-04	21.99	300	4,335.00	5,460.00	-
600654	中安消	2016-05-19	重大事项	21.50	2016-08-08	20.39	200	3,708.00	4,300.00	-
601168	西部矿业	2016-02-01	重大事项	5.93	2016-07-22	6.52	700	4,199.00	4,151.00	-
600005	武钢股份	2016-06-27	重大事项	2.76	-	-	1,500	4,215.00	4,140.00	-
600497	驰宏锌锗	2016-06-13	重大事项	9.97	2016-07-11	10.97	400	3,988.00	3,988.00	-

600166	福田汽车	2016-06-30	重大事项	5.52	2016-07-01	5.62	700	3,871.00	3,864.00	-
600759	洲际油气	2016-06-27	重大事项	7.58	2016-07-11	8.10	500	3,885.00	3,790.00	-
002373	千方科技	2016-05-12	重大事项	14.94	2016-08-16	16.43	200	3,408.00	2,988.00	-
600634	中技控股	2016-06-22	重大事项	14.41	-	-	200	2,882.00	2,882.00	-
600330	天通股份	2016-05-23	重大事项	13.93	-	-	200	2,786.00	2,786.00	-
600511	国药股份	2016-02-18	重大事项	27.42	2016-08-04	30.16	100	2,752.00	2,742.00	-
600139	西部资源	2016-04-11	重大事项	12.31	2016-08-15	12.99	200	2,462.00	2,462.00	-
600614	鼎立股份	2016-04-26	重大事项	8.14	-	-	300	2,445.00	2,442.00	-
600653	申华控股	2016-05-05	重大事项	3.93	-	-	600	2,358.00	2,358.00	-
600896	中海海盛	2016-05-23	重大事项	10.54	-	-	200	2,108.00	2,108.00	-
002280	联络互动	2016-04-25	重大事项	19.71	-	-	100	2,227.00	1,971.00	-
600640	号百控股	2016-04-18	重大事项	16.79	2016-08-22	18.44	100	1,679.00	1,679.00	-
600577	精达股份	2016-05-03	重大事项	4.18	-	-	400	1,672.00	1,672.00	-
600986	科达股份	2016-06-27	重大事项	15.98	2016-07-18	17.58	100	1,640.00	1,598.00	-
601005	重庆钢铁	2016-06-02	重大事项	2.52	-	-	400	1,008.00	1,008.00	-
000629	*ST 钒钛	2016-05-26	重大事项	2.39	-	-	400	1,285.00	956.00	-
000511	*ST 烯碳	2016-04-26	重大事项	8.92	-	-	100	923.00	892.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.29	-	-	100	906.00	829.00	-
002663	普邦园林	2016-04-28	重大事项	7.36	-	-	100	706.00	736.00	-
600432	*ST 吉恩	2016-06-23	重大事项	7.10	2016-07-05	7.46	100	967.00	710.00	-
002266	浙富控股	2016-05-25	重大事项	5.35	-	-	100	617.00	535.00	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止, 本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止, 本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后, 通过正式报告的方式, 将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会, 协助制定风险控制决策, 实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法, 估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重性; 从定量分析的角度出发, 根据本基金的投资目标, 结合基金资产所运用的金融工具特征, 通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告, 确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时对各种风险进行监督、检查和评估, 并制定相应决策, 将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 债券发行人信用评级降低导致债券价格下降, 或基金在交易过程中发生交收违约, 而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库, 对发行人及债券投资进行内部评级, 对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度, 以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下, 基金管理人可能无法

迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 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 Beta 值等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 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金为 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金的其他价格风险与目标 ETF 基金相似。

本基金管理人通常用 Beta 值等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 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,814,026.34	2.76	1,476,568.50	1.22
交易性金融资产-基金投资	93,763,357.11	92.02	113,126,403.47	93.61
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	96,577,383.45	94.78	114,602,971.97	94.84

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为 MSCI 中国 A 股指数变动时，各类持仓资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定 MSCI 中国 A 股指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、Beta 系数是根据组合在报表日各类持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
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 （2016 年 6 月 30 日）	上年度末 （2015 年 12 月 31 日）
	+5%	5,691,507.22	5,470,568.13
	-5%	-5,691,507.22	-5,470,568.13

#### 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 2016 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 96,579,755.35 元，第二层次的余额为 9,760.00 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2015 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 114,332,161.47 元，第二层次的余额为 285,092.90 元，第三层次的余额为 0 元。）

##### 6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票、收盘价异常的债券，本基金将相关股票和债券公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌、债券收盘价能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第

三层次转入第一层次。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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 20 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将其公允价值从第一层次调整至第二层次。

#### 6.4.14.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,814,026.34	2.74
	其中：股票	2,814,026.34	2.74
2	基金投资	93,763,357.11	91.21
3	固定收益投资	12,131.90	0.01
	其中：债券	12,131.90	0.01
	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	6,133,481.92	5.97
8	其他各项资产	75,808.90	0.07
9	合计	102,798,806.17	100.00

### 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	------	-----	------	---------------

1	华夏 MSCI 中国 A 股 ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	93,763,357.11	92.02
---	--------------------	-----	--------	------------	---------------	-------

## 7.3 期末按行业分类的股票投资组合

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	10,882.00	0.01
B	采矿业	127,053.64	0.12
C	制造业	948,016.10	0.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	115,469.00	0.11
E	建筑业	98,500.80	0.10
F	批发和零售业	105,228.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	128,941.00	0.13
H	住宿和餐饮业	3,346.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,768.00	0.12
J	金融业	954,888.00	0.94
K	房地产业	136,655.80	0.13
L	租赁和商务服务业	14,885.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	3,514.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,267.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,118.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	22,097.00	0.02
S	综合	21,397.00	0.02
	合计	2,814,026.34	2.76

## 7.4 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	3,800	121,752.00	0.12
2	600016	民生银行	10,200	91,086.00	0.09
3	600036	招商银行	4,900	85,750.00	0.08
4	601166	兴业银行	4,900	74,676.00	0.07
5	600000	浦发银行	4,600	71,622.00	0.07
6	600519	贵州茅台	200	58,384.00	0.06

7	600030	中信证券	3,200	51,936.00	0.05
8	601328	交通银行	6,900	38,847.00	0.04
9	600837	海通证券	2,500	38,550.00	0.04
10	601169	北京银行	3,600	37,332.00	0.04
11	600887	伊利股份	2,100	35,007.00	0.03
12	601288	农业银行	10,200	32,640.00	0.03
13	601398	工商银行	7,000	31,080.00	0.03
14	601668	中国建筑	5,200	27,664.00	0.03
15	601766	中国中车	3,000	27,510.00	0.03
16	601601	中国太保	1,000	27,040.00	0.03
17	601818	光大银行	6,100	22,936.00	0.02
18	601989	中国重工	3,600	22,788.00	0.02
19	600900	长江电力	1,800	22,482.00	0.02
20	601988	中国银行	6,400	20,544.00	0.02
21	600104	上汽集团	1,000	20,290.00	0.02
22	600276	恒瑞医药	500	20,055.00	0.02
23	600048	保利地产	2,300	19,849.00	0.02
24	601688	华泰证券	1,000	18,920.00	0.02
25	600518	康美药业	1,100	16,709.00	0.02
26	600028	中国石化	3,200	15,104.00	0.01
27	601006	大秦铁路	2,200	14,168.00	0.01
28	601390	中国中铁	2,000	13,940.00	0.01
29	601939	建设银行	2,900	13,775.00	0.01
30	600570	恒生电子	200	13,354.00	0.01
31	600999	招商证券	800	13,200.00	0.01
32	601009	南京银行	1,300	12,207.00	0.01
33	600050	中国联通	3,200	12,192.00	0.01
34	600703	三安光电	600	11,982.00	0.01
35	601377	兴业证券	1,600	11,824.00	0.01
36	600547	山东黄金	300	11,673.00	0.01
37	601985	中国核电	1,700	11,611.00	0.01
38	601899	紫金矿业	3,300	11,121.00	0.01
39	600015	华夏银行	1,100	10,879.00	0.01
40	600120	浙江东方	500	10,855.00	0.01
41	600795	国电电力	3,700	10,841.00	0.01
42	601901	方正证券	1,400	10,724.00	0.01
43	601211	国泰君安	600	10,674.00	0.01

44	600690	青岛海尔	1,200	10,656.00	0.01
45	600111	北方稀土	800	10,648.00	0.01
46	600705	中航资本	1,800	10,584.00	0.01
47	600100	同方股份	700	10,472.00	0.01
48	600009	上海机场	400	10,420.00	0.01
49	600893	中航动力	300	10,395.00	0.01
50	600585	海螺水泥	700	10,178.00	0.01
51	601857	中国石油	1,400	10,122.00	0.01
52	600010	包钢股份	3,500	10,010.00	0.01
53	601186	中国铁建	1,000	9,960.00	0.01
54	600066	宇通客车	500	9,900.00	0.01
55	600886	国投电力	1,500	9,900.00	0.01
56	601099	太平洋	1,600	9,808.00	0.01
57	600522	中天科技	1,000	9,800.00	0.01
58	600637	东方明珠	400	9,708.00	0.01
59	600153	建发股份	800	9,600.00	0.01
60	600271	航天信息	400	9,520.00	0.01
61	600109	国金证券	700	9,436.00	0.01
62	601555	东吴证券	700	9,380.00	0.01
63	600089	特变电工	1,100	9,372.00	0.01
64	600804	鹏博士	500	9,115.00	0.01
65	600309	万华化学	500	8,650.00	0.01
66	603016	新宏泰	1,000	8,490.00	0.01
67	600029	南方航空	1,200	8,472.00	0.01
68	601788	光大证券	500	8,470.00	0.01
69	601088	中国神华	600	8,442.00	0.01
70	600958	东方证券	500	8,405.00	0.01
71	601628	中国人寿	400	8,328.00	0.01
72	600383	金地集团	800	8,288.00	0.01
73	600177	雅戈尔	600	8,274.00	0.01
74	600489	中金黄金	736	8,272.64	0.01
75	601336	新华保险	200	8,080.00	0.01
76	600031	三一重工	1,600	8,032.00	0.01
77	600406	国电南瑞	600	8,022.00	0.01
78	600369	西南证券	1,100	7,986.00	0.01
79	600739	辽宁成大	500	7,785.00	0.01
80	600352	浙江龙盛	900	7,758.00	0.01

81	600196	复星医药	400	7,608.00	0.01
82	600340	华夏幸福	300	7,314.00	0.01
83	600221	海南航空	2,300	7,291.00	0.01
84	600115	东方航空	1,100	7,271.00	0.01
85	600446	金证股份	200	7,190.00	0.01
86	600649	城投控股	500	7,180.00	0.01
87	600535	天士力	200	7,152.00	0.01
88	600741	华域汽车	500	7,005.00	0.01
89	600660	福耀玻璃	500	7,000.00	0.01
90	600019	宝钢股份	1,400	6,860.00	0.01
91	601669	中国电建	1,200	6,852.00	0.01
92	600011	华能国际	900	6,768.00	0.01
93	600436	片仔癀	150	6,751.50	0.01
94	600118	中国卫星	200	6,720.00	0.01
95	600079	人福医药	400	6,708.00	0.01
96	600482	中国动力	200	6,554.00	0.01
97	601600	中国铝业	1,700	6,409.00	0.01
98	600068	葛洲坝	1,100	6,402.00	0.01
99	600487	亨通光电	500	6,290.00	0.01
100	601618	中国中冶	1,700	6,273.00	0.01
101	601998	中信银行	1,100	6,237.00	0.01
102	600879	航天电子	400	6,232.00	0.01
103	600867	通化东宝	300	6,207.00	0.01
104	601933	永辉超市	1,500	6,195.00	0.01
105	600839	四川长虹	1,400	6,188.00	0.01
106	600584	长电科技	300	6,087.00	0.01
107	601727	上海电气	800	6,048.00	0.01
108	600074	保千里	400	5,968.00	0.01
109	600085	同仁堂	200	5,958.00	0.01
110	600549	厦门钨业	200	5,942.00	0.01
111	600027	华电国际	1,200	5,940.00	0.01
112	600219	南山铝业	800	5,920.00	0.01
113	600588	用友网络	300	5,874.00	0.01
114	600820	隧道股份	700	5,873.00	0.01
115	600674	川投能源	700	5,782.00	0.01
116	600315	上海家化	200	5,768.00	0.01
117	600259	广晟有色	100	5,726.00	0.01

118	600682	南京新百	200	5,694.00	0.01
119	600023	浙能电力	1,100	5,599.00	0.01
120	600978	宜华生活	500	5,570.00	0.01
121	600208	新潮中宝	1,300	5,499.00	0.01
122	600718	东软集团	300	5,496.00	0.01
123	600201	生物股份	200	5,466.00	0.01
124	000002	万科A	300	5,460.00	0.01
125	601018	宁波港	1,100	5,445.00	0.01
126	600895	张江高科	300	5,424.00	0.01
127	601607	上海医药	300	5,415.00	0.01
128	600485	信威集团	300	5,352.00	0.01
129	600061	国投安信	300	5,346.00	0.01
130	600158	中体产业	300	5,325.00	0.01
131	600435	北方导航	400	5,324.00	0.01
132	600060	海信电器	300	5,304.00	0.01
133	601012	隆基股份	400	5,220.00	0.01
134	601106	中国一重	1,000	5,210.00	0.01
135	600252	中恒集团	1,200	5,208.00	0.01
136	600642	申能股份	900	5,166.00	0.01
137	600884	杉杉股份	300	5,163.00	0.01
138	601919	中国远洋	1,000	5,080.00	0.00
139	600816	安信信托	300	5,061.00	0.00
140	600388	龙净环保	400	5,024.00	0.00
141	600266	北京城建	400	4,996.00	0.00
142	600770	综艺股份	400	4,984.00	0.00
143	600415	小商品城	800	4,944.00	0.00
144	600332	白云山	200	4,928.00	0.00
145	600256	广汇能源	1,200	4,920.00	0.00
146	600110	诺德股份	500	4,920.00	0.00
147	601198	东兴证券	200	4,888.00	0.00
148	600643	爱建集团	500	4,885.00	0.00
149	600521	华海药业	200	4,864.00	0.00
150	600498	烽火通信	200	4,856.00	0.00
151	600583	海油工程	700	4,837.00	0.00
152	600635	大众公用	800	4,824.00	0.00
153	601021	春秋航空	100	4,794.00	0.00
154	600594	益佰制药	300	4,794.00	0.00

155	600366	宁波韵升	200	4,774.00	0.00
156	600312	平高电气	300	4,698.00	0.00
157	603111	康尼机电	350	4,697.00	0.00
158	601333	广深铁路	1,200	4,692.00	0.00
159	600737	中粮屯河	400	4,620.00	0.00
160	600018	上港集团	900	4,590.00	0.00
161	600503	华丽家族	500	4,585.00	0.00
162	600037	歌华有线	300	4,563.00	0.00
163	600663	陆家嘴	200	4,550.00	0.00
164	600150	中国船舶	200	4,452.00	0.00
165	600376	首开股份	400	4,448.00	0.00
166	600006	东风汽车	500	4,435.00	0.00
167	601258	庞大集团	1,600	4,400.00	0.00
168	601888	中国国旅	100	4,398.00	0.00
169	600655	豫园商城	400	4,336.00	0.00
170	600157	永泰能源	1,100	4,334.00	0.00
171	600654	中安消	200	4,300.00	0.00
172	600170	上海建工	1,100	4,213.00	0.00
173	600959	江苏有线	300	4,188.00	0.00
174	600525	长园集团	300	4,155.00	0.00
175	601168	西部矿业	700	4,151.00	0.00
176	600373	中文传媒	200	4,150.00	0.00
177	600038	中直股份	100	4,148.00	0.00
178	600664	哈药股份	500	4,145.00	0.00
179	600005	武钢股份	1,500	4,140.00	0.00
180	600868	梅雁吉祥	800	4,120.00	0.00
181	600362	江西铜业	300	4,044.00	0.00
182	603766	隆鑫通用	200	4,044.00	0.00
183	600122	宏图高科	300	4,014.00	0.00
184	600240	华业资本	400	4,008.00	0.00
185	600497	驰宏锌锗	400	3,988.00	0.00
186	603019	中科曙光	100	3,982.00	0.00
187	600198	大唐电信	200	3,976.00	0.00
188	600755	厦门国贸	500	3,975.00	0.00
189	601866	中海集运	1,000	3,960.00	0.00
190	600875	东方电气	400	3,928.00	0.00
191	600372	中航电子	200	3,894.00	0.00

192	600200	江苏吴中	200	3,874.00	0.00
193	600601	方正科技	900	3,870.00	0.00
194	600166	福田汽车	700	3,864.00	0.00
195	600138	中青旅	200	3,864.00	0.00
196	600143	金发科技	600	3,864.00	0.00
197	600694	大商股份	100	3,852.00	0.00
198	600391	成发科技	100	3,845.00	0.00
199	600699	均胜电子	100	3,830.00	0.00
200	601718	际华集团	500	3,820.00	0.00
201	600418	江淮汽车	300	3,804.00	0.00
202	600094	大名城	400	3,800.00	0.00
203	600651	飞乐音响	300	3,798.00	0.00
204	600759	洲际油气	500	3,790.00	0.00
205	601877	正泰电器	200	3,770.00	0.00
206	600058	五矿发展	200	3,754.00	0.00
207	600673	东阳光科	600	3,750.00	0.00
208	600704	物产中大	400	3,744.00	0.00
209	601872	招商轮船	800	3,744.00	0.00
210	603993	洛阳钼业	900	3,735.00	0.00
211	600872	中炬高新	300	3,702.00	0.00
212	600711	盛屯矿业	500	3,700.00	0.00
213	600172	黄河旋风	200	3,686.00	0.00
214	601519	大智慧	400	3,676.00	0.00
215	600688	上海石化	600	3,660.00	0.00
216	600516	方大炭素	400	3,656.00	0.00
217	600827	百联股份	300	3,624.00	0.00
218	601098	中南传媒	200	3,622.00	0.00
219	600478	科力远	300	3,621.00	0.00
220	600500	中化国际	400	3,616.00	0.00
221	600185	格力地产	580	3,601.80	0.00
222	600298	安琪酵母	200	3,568.00	0.00
223	600426	华鲁恒升	400	3,524.00	0.00
224	600645	中源协和	100	3,514.00	0.00
225	600528	中铁二局	300	3,483.00	0.00
226	600666	奥瑞德	100	3,476.00	0.00
227	600171	上海贝岭	200	3,474.00	0.00
228	600053	九鼎投资	100	3,463.00	0.00

229	600562	国睿科技	100	3,429.00	0.00
230	600611	大众交通	500	3,405.00	0.00
231	600151	航天机电	300	3,390.00	0.00
232	600499	科达洁能	200	3,382.00	0.00
233	600797	浙大网新	300	3,381.00	0.00
234	601111	中国国航	500	3,380.00	0.00
235	600881	亚泰集团	700	3,374.00	0.00
236	600410	华胜天成	300	3,366.00	0.00
237	600754	锦江股份	100	3,346.00	0.00
238	600811	东方集团	500	3,330.00	0.00
239	600863	内蒙华电	1,100	3,322.00	0.00
240	603000	人民网	200	3,322.00	0.00
241	600325	华发股份	300	3,321.00	0.00
242	601117	中国化学	600	3,318.00	0.00
243	600392	盛和资源	200	3,276.00	0.00
244	600687	刚泰控股	200	3,252.00	0.00
245	600572	康恩贝	500	3,240.00	0.00
246	600565	迪马股份	500	3,230.00	0.00
247	600490	鹏欣资源	400	3,196.00	0.00
248	600967	北方创业	300	3,189.00	0.00
249	600160	巨化股份	300	3,189.00	0.00
250	600307	酒钢宏兴	1,300	3,185.00	0.00
251	600750	江中药业	100	3,180.00	0.00
252	600056	中国医药	200	3,172.00	0.00
253	601928	凤凰传媒	300	3,162.00	0.00
254	600598	北大荒	300	3,159.00	0.00
255	601800	中国交建	300	3,159.00	0.00
256	600662	强生控股	300	3,141.00	0.00
257	600855	航天长峰	100	3,130.00	0.00
258	600763	通策医疗	100	3,118.00	0.00
259	600458	时代新材	200	3,116.00	0.00
260	600008	首创股份	800	3,112.00	0.00
261	601992	金隅股份	400	3,100.00	0.00
262	600021	上海电力	300	3,081.00	0.00
263	600885	宏发股份	100	3,071.00	0.00
264	601179	中国西电	600	3,042.00	0.00
265	600108	亚盛集团	600	3,030.00	0.00

266	600650	锦江投资	100	3,025.00	0.00
267	600633	浙报传媒	200	3,008.00	0.00
268	600775	南京熊猫	200	2,990.00	0.00
269	600064	南京高科	200	2,990.00	0.00
270	002373	千方科技	200	2,988.00	0.00
271	601216	君正集团	400	2,988.00	0.00
272	600320	振华重工	700	2,975.00	0.00
273	600787	中储股份	400	2,972.00	0.00
274	600026	中海发展	500	2,950.00	0.00
275	600495	晋西车轴	400	2,932.00	0.00
276	600728	佳都科技	300	2,916.00	0.00
277	600765	中航重机	200	2,916.00	0.00
278	600600	青岛啤酒	100	2,907.00	0.00
279	600652	游久游戏	200	2,904.00	0.00
280	600086	东方金钰	300	2,904.00	0.00
281	600067	冠城大通	400	2,884.00	0.00
282	600634	中技控股	200	2,882.00	0.00
283	600210	紫江企业	500	2,880.00	0.00
284	600176	中国巨石	300	2,871.00	0.00
285	600567	山鹰纸业	1,000	2,840.00	0.00
286	600862	中航高科	200	2,836.00	0.00
287	601929	吉视传媒	700	2,821.00	0.00
288	600289	亿阳信通	200	2,798.00	0.00
289	601118	海南橡胶	500	2,795.00	0.00
290	600330	天通股份	200	2,786.00	0.00
291	600183	生益科技	300	2,781.00	0.00
292	600161	天坛生物	100	2,779.00	0.00
293	601155	新城控股	300	2,778.00	0.00
294	600039	四川路桥	700	2,758.00	0.00
295	600380	健康元	300	2,754.00	0.00
296	600511	国药股份	100	2,742.00	0.00
297	600736	苏州高新	300	2,739.00	0.00
298	600169	太原重工	700	2,730.00	0.00
299	600422	昆药集团	200	2,728.00	0.00
300	601890	亚星锚链	300	2,727.00	0.00
301	600400	红豆股份	300	2,724.00	0.00
302	600409	三友化工	400	2,696.00	0.00

303	600206	有研新材	200	2,690.00	0.00
304	600745	中茵股份	100	2,684.00	0.00
305	600894	广日股份	200	2,666.00	0.00
306	600851	海欣股份	200	2,662.00	0.00
307	600216	浙江医药	200	2,638.00	0.00
308	600826	兰生股份	100	2,618.00	0.00
309	601699	潞安环能	400	2,616.00	0.00
310	600717	天津港	300	2,607.00	0.00
311	600805	悦达投资	300	2,604.00	0.00
312	600433	冠豪高新	300	2,592.00	0.00
313	600399	抚顺特钢	400	2,588.00	0.00
314	601898	中煤能源	500	2,580.00	0.00
315	600880	博瑞传播	300	2,553.00	0.00
316	600348	阳泉煤业	400	2,548.00	0.00
317	600125	铁龙物流	400	2,548.00	0.00
318	600597	光明乳业	200	2,536.00	0.00
319	600685	中船防务	100	2,536.00	0.00
320	601633	长城汽车	300	2,532.00	0.00
321	600970	中材国际	400	2,520.00	0.00
322	600639	浦东金桥	100	2,498.00	0.00
323	600416	湘电股份	200	2,494.00	0.00
324	600536	中国软件	100	2,492.00	0.00
325	600812	华北制药	400	2,484.00	0.00
326	600873	梅花生物	400	2,484.00	0.00
327	600729	重庆百货	100	2,480.00	0.00
328	600139	西部资源	200	2,462.00	0.00
329	603077	和邦生物	500	2,460.00	0.00
330	600004	白云机场	200	2,452.00	0.00
331	601958	金钼股份	300	2,445.00	0.00
332	600614	鼎立股份	300	2,442.00	0.00
333	600267	海正药业	200	2,430.00	0.00
334	600017	日照港	600	2,430.00	0.00
335	600807	天业股份	200	2,424.00	0.00
336	600808	马钢股份	1,000	2,410.00	0.00
337	600277	亿利洁能	400	2,380.00	0.00
338	600343	航天动力	100	2,378.00	0.00
339	601880	大连港	400	2,364.00	0.00

340	600653	中华控股	600	2,358.00	0.00
341	600550	保变电气	400	2,356.00	0.00
342	601777	力帆股份	200	2,354.00	0.00
343	600175	美都能源	500	2,350.00	0.00
344	600098	广州发展	300	2,346.00	0.00
345	601801	皖新传媒	200	2,334.00	0.00
346	601000	唐山港	600	2,328.00	0.00
347	600587	新华医疗	100	2,309.00	0.00
348	600836	界龙实业	200	2,298.00	0.00
349	600073	上海梅林	200	2,290.00	0.00
350	600220	江苏阳光	500	2,280.00	0.00
351	600595	中孚实业	400	2,256.00	0.00
352	600428	中远航运	400	2,244.00	0.00
353	600580	卧龙电气	200	2,242.00	0.00
354	600187	国中水务	500	2,230.00	0.00
355	601558	华锐风电	800	2,224.00	0.00
356	600809	山西汾酒	100	2,218.00	0.00
357	600269	赣粤高速	500	2,175.00	0.00
358	600255	鑫科材料	500	2,170.00	0.00
359	600783	鲁信创投	100	2,161.00	0.00
360	600123	兰花科创	300	2,154.00	0.00
361	601001	大同煤业	400	2,148.00	0.00
362	601608	中信重工	400	2,148.00	0.00
363	601588	北辰实业	500	2,135.00	0.00
364	000839	中信国安	100	2,131.00	0.00
365	600261	阳光照明	300	2,118.00	0.00
366	600896	中海海盛	200	2,108.00	0.00
367	600284	浦东建设	200	2,088.00	0.00
368	601010	文峰股份	400	2,076.00	0.00
369	600823	世茂股份	300	2,037.00	0.00
370	600291	西水股份	100	1,987.00	0.00
371	601311	骆驼股份	100	1,985.00	0.00
372	600648	外高桥	100	1,971.00	0.00
373	002280	联络互动	100	1,971.00	0.00
374	600557	康缘药业	120	1,959.60	0.00
375	600316	洪都航空	100	1,951.00	0.00
376	600835	上海机电	100	1,919.00	0.00

377	600438	通威股份	300	1,908.00	0.00
378	600517	置信电气	200	1,902.00	0.00
379	600033	福建高速	600	1,902.00	0.00
380	000998	隆平高科	100	1,898.00	0.00
381	600022	山东钢铁	800	1,896.00	0.00
382	600282	南钢股份	800	1,880.00	0.00
383	600096	云天化	200	1,860.00	0.00
384	600062	华润双鹤	100	1,822.00	0.00
385	600582	天地科技	400	1,800.00	0.00
386	600824	益民集团	300	1,791.00	0.00
387	600676	交运股份	200	1,786.00	0.00
388	600300	维维股份	300	1,782.00	0.00
389	600020	中原高速	400	1,768.00	0.00
390	600998	九州通	100	1,751.00	0.00
391	600270	外运发展	100	1,749.00	0.00
392	600747	大连控股	400	1,748.00	0.00
393	600568	中珠控股	100	1,740.00	0.00
394	600329	中新药业	100	1,727.00	0.00
395	600555	海航创新	300	1,719.00	0.00
396	600481	双良节能	300	1,719.00	0.00
397	600578	京能电力	400	1,712.00	0.00
398	600466	蓝光发展	200	1,712.00	0.00
399	601717	郑煤机	300	1,710.00	0.00
400	600317	营口港	500	1,680.00	0.00
401	600640	号百控股	100	1,679.00	0.00
402	600776	东方通信	200	1,678.00	0.00
403	600757	长江传媒	200	1,678.00	0.00
404	600577	精达股份	400	1,672.00	0.00
405	600395	盘江股份	200	1,652.00	0.00
406	600744	华银电力	300	1,647.00	0.00
407	600630	龙头股份	100	1,641.00	0.00
408	600331	宏达股份	300	1,638.00	0.00
409	601666	平煤股份	400	1,636.00	0.00
410	600986	科达股份	100	1,598.00	0.00
411	600825	新华传媒	200	1,590.00	0.00
412	600874	创业环保	200	1,554.00	0.00
413	601908	京运通	200	1,534.00	0.00

414	600859	王府井	100	1,524.00	0.00
415	600180	瑞茂通	100	1,511.00	0.00
416	600726	华电能源	300	1,491.00	0.00
417	600686	金龙汽车	100	1,473.00	0.00
418	600072	钢构工程	100	1,391.00	0.00
419	600280	中央商场	200	1,352.00	0.00
420	600337	美克家居	100	1,301.00	0.00
421	601369	陕鼓动力	200	1,276.00	0.00
422	601636	旗滨集团	400	1,272.00	0.00
423	600323	瀚蓝环境	100	1,269.00	0.00
424	600292	远达环保	100	1,267.00	0.00
425	601808	中海油服	100	1,215.00	0.00
426	600628	新世界	100	1,180.00	0.00
427	601233	桐昆股份	100	1,086.00	0.00
428	601005	重庆钢铁	400	1,008.00	0.00
429	600748	上实发展	100	964.00	0.00
430	000629	*ST 钒钛	400	956.00	0.00
431	000511	*ST 烯碳	100	892.00	0.00
432	002340	格林美	100	877.00	0.00
433	601002	晋亿实业	100	870.00	0.00
434	002129	中环股份	100	829.00	0.00
435	002663	普邦园林	100	736.00	0.00
436	601918	*ST 新集	200	726.00	0.00
437	600432	*ST 吉恩	100	710.00	0.00
438	600236	桂冠电力	100	672.00	0.00
439	002266	浙富控股	100	535.00	0.00
440	002325	洪涛股份	20	183.80	0.00

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 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	601318	中国平安	71,522.00	0.06
2	600016	民生银行	54,360.00	0.04
3	600036	招商银行	51,771.00	0.04
4	601166	兴业银行	46,922.00	0.04
5	600000	浦发银行	43,600.00	0.04

6	600519	贵州茅台	26,463.00	0.02
7	601328	交通银行	22,550.00	0.02
8	601169	北京银行	22,423.89	0.02
9	600837	海通证券	22,009.00	0.02
10	600887	伊利股份	19,903.00	0.02
11	601288	农业银行	18,762.00	0.02
12	601398	工商银行	18,270.00	0.02
13	601766	中国中车	17,280.00	0.01
14	601668	中国建筑	16,380.00	0.01
15	601601	中国太保	16,332.00	0.01
16	601818	光大银行	13,801.00	0.01
17	601989	中国重工	13,552.00	0.01
18	600900	长江电力	12,410.00	0.01
19	600048	保利地产	11,844.00	0.01
20	601688	华泰证券	11,058.00	0.01

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。

#### 7.5.2 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	107,872.00	0.09
2	300496	中科创达	107,614.00	0.09
3	600036	招商银行	84,480.00	0.07
4	600016	民生银行	80,631.00	0.07
5	300495	美尚生态	71,425.00	0.06
6	600000	浦发银行	69,695.60	0.06
7	600271	航天信息	68,612.70	0.06
8	601166	兴业银行	67,670.00	0.06
9	600690	青岛海尔	55,748.00	0.05
10	600030	中信证券	47,981.00	0.04
11	600153	建发股份	37,352.00	0.03
12	601328	交通银行	36,216.00	0.03
13	300497	富祥股份	35,597.00	0.03
14	601018	宁波港	34,695.00	0.03
15	601169	北京银行	33,581.00	0.03

16	600837	海通证券	30,771.00	0.03
17	600219	南山铝业	30,150.00	0.02
18	601766	中国中车	30,065.00	0.02
19	601288	农业银行	27,389.00	0.02
20	601988	中国银行	26,660.00	0.02

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。

### 7.5.3 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	1,996,170.41
卖出股票收入（成交）总额	3,364,068.30

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。

### 7.6 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）	12,131.90	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,131.90	0.01

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	110031	航信转债	110	12,131.90	0.01
2	-	-	-	-	-

3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

##### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.12.1 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。

##### 7.12.2 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。

##### 7.12.3 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。

#### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 2015 年 9 月 10 日海通证券收到了中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚事先告知书》。本基金为指数型联接基金，主要采取复制策略，海通证券系目标 ETF 的指数成份股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

7.13.2 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。

7.13.3 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	9,664.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,406.91
5	应收申购款	18,506.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	46,231.10
9	合计	75,808.90

## 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	12,131.90	0.01

## 7.13.5 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。

## 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,374	34,100.85	-	-	115,056,258.44	100.00%

## 8.2 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	157,240.17	0.14%

## 8.3 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	0

研究部门负责人持有本开放式基金	
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（2015年2月12日）基金份额总额	595,618,957.58
本报告期期初基金份额总额	116,845,318.50
本报告期基金总申购份额	22,856,774.22
减：本报告期基金总赎回份额	24,645,834.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	115,056,258.44

## §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

根据本基金管理人发布的相关公告，孙毅先生自 2016 年 1 月 1 日起任华夏基金管理有限公司副总经理，自 2016 年 6 月 30 日起不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

### 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	
中国银河证券	1	4,314,233.25	80.62%	3,154.99	80.62%	-
国泰君安证券	1	1,036,917.94	19.38%	758.25	19.38%	-

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，本基金无其他交易单元。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

#### 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
中国银河证券	-	-	1,600,000.00	100.00%

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指	2016-01-04

		定报刊及网站	
3	华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-07
4	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-13
5	华夏基金管理有限公司关于调整中国建设银行储蓄卡基金电子交易优惠费率的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-21
6	华夏基金管理有限公司关于设立上海华夏财富投资管理有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-30
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增联讯证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-18
8	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江南农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-03
9	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-04
10	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-04
11	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邮政储蓄银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-09
12	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-23
13	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-15
14	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增深圳众禄金融控股股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-10
15	关于停止支付宝基金专户电子交易开户及认购、申购、定期定额申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-13
16	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海中正达广投资管理有限公司、北京汇成基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-24
17	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开	中国证监会指	2016-05-26

	放式基金在上海天天基金销售有限公司调整申购、赎回数额限制的公告	定报刊及网站	
18	华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-26
19	华夏基金管理有限公司关于 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-08

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

11.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；

11.1.2 《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合同》；

11.1.3 《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

11.1.4 法律意见书；

11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 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。

### 11.3 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

二〇一六年八月二十七日