

# 华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

## 2017 年半年度报告摘要

2017 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华夏沪深 300 指数增强	
基金主代码	001015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 2 月 10 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	320,852,504.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	001015	001016
报告期末下属分级基金的份额总额	236,291,401.64 份	84,561,103.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金主要通过采取股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准 = 95% × 沪深 300 指数收益率 + 1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	95599
传真	010-63136700	010-68121816

### 2.4 信息披露方式

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

### §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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）	
	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	5,314,851.60	1,477,229.36
本期利润	31,743,891.91	11,802,110.78
加权平均基金份额本期利润	0.1396	0.1334
本期加权平均净值利润率	11.40%	11.02%
本期基金份额净值增长率	11.62%	11.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C
期末可供分配利润	72,395,870.58	24,583,832.40
期末可供分配基金份额利润	0.3064	0.2907
期末基金资产净值	308,687,272.22	109,144,935.46
期末基金份额净值	1.306	1.291
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	30.60%	29.10%

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

华夏沪深 300 指数增强 A

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	5.58%	0.61%	4.85%	0.64%	0.73%	-0.03%
过去三个月	6.01%	0.60%	6.17%	0.59%	-0.16%	0.01%
过去六个月	11.62%	0.55%	10.98%	0.54%	0.64%	0.01%

过去一年	21.60%	0.65%	16.95%	0.64%	4.65%	0.01%
自基金合同生效起至今	30.60%	1.78%	12.69%	1.71%	17.91%	0.07%

华夏沪深 300 指数增强 C

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	5.56%	0.61%	4.85%	0.64%	0.71%	-0.03%
过去三个月	5.91%	0.60%	6.17%	0.59%	-0.26%	0.01%
过去六个月	11.39%	0.55%	10.98%	0.54%	0.41%	0.01%
过去一年	21.11%	0.65%	16.95%	0.64%	4.16%	0.01%
自基金合同生效起至今	29.10%	1.79%	12.69%	1.71%	16.41%	0.08%

3.2.1 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 指数增强型证券投资基金

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

(2015 年 2 月 10 日至 2017 年 6 月 30 日)

华夏沪深 300 指数增强 A



华夏沪深 300 指数增强 C



## §4 管理人报告

### 4.1 基金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，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、华夏沪港通恒生 ETF 和华夏快线 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、海外市场指数等的产品线。今年 6 月，A 股成功纳入 MSCI 新兴市场指数，作为境内率先推

出的跟踪 MSCI 中国 A 股指数的 ETF 基金，华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 受到市场广泛关注。

在《中国证券报》主办的第十四届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2016 年度被动投资金牛基金公司”奖。

在客户服务方面，2017 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）下调旗下开放式基金在直销机构及华夏财富的申购、赎回等业务最低数量限制，更好地满足客户理财需求；（2）新增开通华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币网上交易快速赎回业务，并且将单日单账户快速赎回份额上调至 50 万份，更好地满足了投资者的流动性需求；（3）网上交易上线中信银行和广发银行快捷支付业务，并与花旗银行、青岛农商银行、国美基金等代销机构合作，拓宽客户交易渠道，提高客户交易便利性；（4）开展“华夏基金 19 周年司庆”、“4 月万物生长，定投让理财生花”、“知识就是红包”等多项客户活动，为客户提供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		
宋洋	本基金的基金经理、数量投资部总监	2016-11-18	-	7 年	中国科学院数学与系统科学研究院博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员等。
王路	本基金的基金经理、数量投资部执行总经理、首席量化投资官	2015-02-10	2017-02-10	19 年	博士。曾任美国纽约德意志资产管理公司基金经理及定量股票研究负责人、美国纽约法兴银行组合经理、大成基金国际业务部副总监等。2008 年 11 月加入华夏基金管理有限公司，

					曾任数量投资部总经理，上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）等。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+1.5%（指年收益率，评价时应按期间折算）。沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指



数是内地首只股指期货的标的指数。本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

上半年，国际方面，全球经济在 1 季度延续了复苏势头，发达经济体普遍通胀回升，欧美经济指标向好，但随着 2 季度的到来，全球制造业采购经理指数（PMI）增长放缓，同时欧洲大选也增加了全球经济的不确定性；美联储于 3 月和 6 月两次加息 25bp，并公布了年内缩表的计划。国内方面，1 季度，工业企业效益明显好转，收入增速和利润增速均出现了较快的增长，工业企业利润有所恢复，产成品库存有所回升；2 季度，宏观经济指标有所回落，但经济韧性依然较强。

市场方面，期初受国内经济复苏、海外市场大涨等多重因素的影响，市场情绪持续高涨，走出一波震荡向上的行情。3 月份，在美联储加息、房地产政策的再度收紧以及外围市场的大跌等多重因素的影响下，A 股出现窄幅震荡。4 月监管部门加强落实“金融防风险”，市场流动性出现恶化，A 股市场随之下跌调整。5 月中旬，随着市场调整幅度到位，市场风险偏好回暖，市场整体呈现出震荡上行的态势。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，华夏沪深 300 指数增强 A 基金份额净值为 1.306 元，本报告期份额净值增长率为 11.62%；华夏沪深 300 指数增强 C 基金份额净值为 1.291 元，本报告期份额净值增长率为 11.39%，同期业绩比较基准增长率为 10.98%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+0.64%，C 类份额跟踪偏离度为+0.41%。

#### 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，全球经济将继续延续复苏势头，全球流动性继续趋紧，同时，英国脱欧谈判的正式启动、德国联邦议会选举、朝鲜半岛问题等一系列政治事件也是需要关注的因素。国内方面，盈利增速可能会有所趋缓，生产与需求将出现回落，但考虑到外需回升的支撑，短期增速依然会较为平稳；流动性周期带来利率上行，在金融强监管、货币政策逐步收紧以及美联储加息等多重压力之下，利率中枢易上难下。在去杠杆、强监管的大背景下，如果经济企稳或有超预期的政策举措，沪深 300 指数将会有较好的投资机会；反之，则可能呈震荡走势。

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超额收益。

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

本基金基金合同规定，本基金的收益分配原则为：由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，若投资者不选择，默认是现金分红方式。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末进行利润分配，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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为,华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		6,621,169.37	22,413,365.75
结算备付金		19,408,223.37	8,989,149.75
存出保证金		66,508.88	3,175,565.27
交易性金融资产		396,183,483.85	261,175,924.70
其中：股票投资		396,183,483.85	261,107,519.30
基金投资		-	-
债券投资		-	68,405.40
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		3,000,000.00	-
应收证券清算款		-	2,001,110.00
应收利息		11,287.95	14,287.53
应收股利		-	-
应收申购款		488,075.96	861,736.10
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		425,778,749.38	298,631,139.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,782,156.46	-
应付赎回款		2,692,868.71	708,837.58
应付管理人报酬		338,467.18	251,922.92
应付托管费		67,693.44	50,384.56
应付销售服务费		45,242.39	41,756.45
应付交易费用		1,905,143.31	1,434,669.68
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		114,970.21	52,460.07
负债合计		7,946,541.70	2,540,031.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		320,852,504.70	253,828,679.02
未分配利润		96,979,702.98	42,262,428.82
所有者权益合计		417,832,207.68	296,091,107.84
负债和所有者权益总计		425,778,749.38	298,631,139.10

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，华夏沪深 300 指数增强 A 基金份额净值 1.306 元，华夏沪深 300 指数增强 C 基金份额净值 1.291 元；华夏沪深 300 指数增强基金份额总额 320,852,504.70 份（其中 A 类 236,291,401.64 份，C 类 84,561,103.06 份）。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>48,907,938.51</b>	<b>-24,979,108.15</b>
1.利息收入		279,247.65	167,975.68
其中：存款利息收入		220,356.15	167,892.62
债券利息收入		36.60	83.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		58,854.90	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,601,128.78	-17,289,507.55
其中：股票投资收益		6,792,057.10	-18,046,342.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益		4,258.45	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		1,050,000.00	-1,835,580.00
股利收益		3,754,813.23	2,592,414.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		36,753,921.73	-8,210,700.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		273,640.35	353,124.25
<b>减：二、费用</b>		<b>5,361,935.82</b>	<b>2,879,962.36</b>
1.管理人报酬		1,909,469.39	1,301,689.41
2.托管费		381,893.91	260,337.88
3.销售服务费		265,264.12	220,404.58
4.交易费用		2,599,787.29	1,018,298.71
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		205,521.11	79,231.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>43,546,002.69</b>	<b>-27,859,070.51</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>43,546,002.69</b>	<b>-27,859,070.51</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	253,828,679.02	42,262,428.82	296,091,107.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,546,002.69	43,546,002.69
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）	67,023,825.68	11,171,271.47	78,195,097.15
其中：1.基金申购款	147,591,048.27	29,698,470.98	177,289,519.25
2.基金赎回款	-80,567,222.59	-18,527,199.51	-99,094,422.10
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）	320,852,504.70	96,979,702.98	417,832,207.68
项目	上年度可比期间 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）	217,130,717.97	45,715,303.66	262,846,021.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-27,859,070.51	-27,859,070.51
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）	42,556,233.80	590,271.24	43,146,505.04
其中：1.基金申购款	114,696,956.56	3,352,973.70	118,049,930.26
2.基金赎回款	-72,140,722.76	-2,762,702.46	-74,903,425.22
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）	259,686,951.77	18,446,504.39	278,133,456.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 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。

##### 6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

##### 6.4.3 关联方关系

###### 6.4.3.1 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。

###### 6.4.3.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人股东控股的公司
上海华夏财富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人股东控股的公司

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。

##### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.4.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.4.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.4.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.4.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,909,469.39	1,301,689.41
其中：支付销售机构的客户维护费	316,563.17	269,770.44

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 1.0%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×1.0%/当年天数。

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

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	381,893.91	260,337.88

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 0.2%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×0.2%/当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏沪深 300 指数增 强 A	华夏沪深 300 指数增强 C	合计
华夏基金管理有限 公司	-	136,066.62	136,066.62
中国农业银行	-	40,249.73	40,249.73
中信证券	-	769.83	769.83



中信证券（山东）	-	235.93	235.93
华夏财富	-	96.69	96.69
合计	-	177,418.80	177,418.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C	合计
华夏基金管理有限公司	-	108,928.55	108,928.55
中国农业银行	-	39,093.02	39,093.02
中信证券	-	568.10	568.10
中信证券（山东）	-	177.41	177.41
华夏财富	-	-	-
合计	-	148,767.08	148,767.08

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额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，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国农业银行活期存款	6,621,169.37	87,418.39	28,740,662.05	113,908.63

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.4.7 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 133,273,980.00 元（上年度可比期间：286,869,420.00 元），支付给中信期货的佣金为 3,265.17 元（上年度可比期间：7,028.28 元）。

#### 6.4.5 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.5.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新发流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新发流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新发流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新发流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

##### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项	6.21	-	-	331,800	2,492,759.56	2,060,478.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	68,300	1,210,343.90	1,522,407.00	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项	17.40	-	-	79,680	1,408,302.00	1,386,432.00	-
601872	招商轮船	2017-05-02	重大事项	5.16	-	-	215,700	1,177,978.00	1,113,012.00	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	6.85	2017-08-21	8.22	148,500	977,173.18	1,017,225.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	74,550	841,401.86	770,101.50	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项	11.32	-	-	65,700	737,195.00	743,724.00	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项	14.12	-	-	39,900	560,439.26	563,388.00	-
002175	东方网络	2017-03-09	重大事项	14.23	2017-07-13	14.74	33,600	548,587.80	478,128.00	-
600559	老白干酒	2017-01-23	重大事项	22.69	-	-	16,600	393,517.00	376,654.00	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大事项	16.31	2017-08-02	16.48	22,000	308,149.00	358,820.00	-
300252	金信诺	2017-04-27	重大事项	21.65	2017-07-27	19.49	10,600	283,714.70	229,490.00	-
002650	加加食品	2017-04-20	重大事项	5.88	-	-	34,294	236,017.74	201,648.72	-
600657	信达地产	2017-02-20	重大事项	5.76	2017-08-10	6.19	29,300	176,082.35	168,768.00	-
300100	双林股份	2017-04-05	重大事项	25.96	-	-	4,630	131,547.90	120,194.80	-
600289	亿阳信通	2017-05-10	重大事项	10.94	2017-08-18	12.03	6,700	74,388.00	73,298.00	-
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项	2.44	2017-08-02	2.44	28,100	77,771.00	68,564.00	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大事项	3.60	-	-	1,000	3,313.41	3,600.00	-

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。

## 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.6.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

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

##### 6.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至 2017 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 394,329,310.85 元，第二层次的余额为 1,854,173.00 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2016 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 261,175,924.70 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。）

##### 6.4.6.3 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，本基金将相关股票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。

##### 6.4.6.4 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。

##### 6.4.6.5 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本

收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益), 不征收增值税; (2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期, 不属于金融商品转让; (3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外, 根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## §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	396,183,483.85	93.05
	其中: 股票	396,183,483.85	93.05
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	3,000,000.00	0.70
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	26,029,392.74	6.11
7	其他各项资产	565,872.79	0.13
8	合计	425,778,749.38	100.00

### 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

##### 7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	432,798.00	0.10
B	采矿业	11,872,293.00	2.84
C	制造业	105,728,663.37	25.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,169,429.00	2.43
E	建筑业	13,529,918.00	3.24
F	批发和零售业	6,782,746.50	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	8,967,895.00	2.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,405,317.00	2.01
J	金融业	134,128,339.82	32.10
K	房地产业	18,294,563.08	4.38
L	租赁和商务服务业	4,042,536.00	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,135,706.00	0.51
S	综合	-	-
	合计	324,490,204.77	77.66

## 7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,381,751.00	0.33
C	制造业	38,400,319.46	9.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,324,622.00	0.56
E	建筑业	4,060,590.00	0.97
F	批发和零售业	2,907,110.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	4,332,692.00	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,400,350.62	1.29
J	金融业	6,245,229.00	1.49
K	房地产业	4,118,183.00	0.99
L	租赁和商务服务业	432,640.00	0.10

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,089,792.00	0.50
S	综合	-	-
	合计	71,693,279.08	17.16

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	369,362	18,324,048.82	4.39
2	000651	格力电器	220,652	9,084,242.84	2.17
3	600519	贵州茅台	19,144	9,033,096.40	2.16
4	000002	万科 A	303,104	7,568,506.88	1.81
5	600036	招商银行	309,100	7,390,581.00	1.77
6	002142	宁波银行	379,100	7,316,630.00	1.75
7	600016	民生银行	861,200	7,079,064.00	1.69
8	601166	兴业银行	418,800	7,060,968.00	1.69
9	601009	南京银行	625,700	7,014,097.00	1.68
10	601997	贵阳银行	437,100	6,910,551.00	1.65

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

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

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	000563	陕国投 A	870,700.00	4,501,519.00	1.08
2	603198	迎驾贡酒	144,000.00	2,740,320.00	0.66
3	002491	通鼎互联	169,300.00	2,275,392.00	0.54
4	600039	四川路桥	526,500.00	2,190,240.00	0.52
5	601000	唐山港	376,700.00	1,966,374.00	0.47

### 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	600000	浦发银行	19,480,692.40	6.58
2	600036	招商银行	18,981,096.60	6.41
3	600837	海通证券	17,458,464.02	5.90
4	600016	民生银行	13,272,780.00	4.48
5	601009	南京银行	11,956,609.72	4.04
6	601318	中国平安	9,375,242.54	3.17
7	601328	交通银行	9,279,847.00	3.13
8	000776	广发证券	8,945,467.91	3.02
9	000750	国海证券	8,508,736.89	2.87
10	601939	建设银行	8,476,884.58	2.86
11	601988	中国银行	8,225,080.00	2.78
12	601211	国泰君安	8,168,008.00	2.76
13	000002	万科 A	7,854,453.98	2.65
14	601555	东吴证券	7,234,881.86	2.44
15	002142	宁波银行	6,941,255.03	2.34
16	601166	兴业银行	6,870,208.00	2.32
17	601997	贵阳银行	6,848,983.88	2.31
18	000725	京东方 A	6,792,748.00	2.29
19	600919	江苏银行	6,761,610.00	2.28
20	600999	招商证券	6,599,278.01	2.23
21	601169	北京银行	6,430,402.29	2.17
22	600519	贵州茅台	6,348,869.89	2.14
23	601688	华泰证券	6,013,748.47	2.03
24	601601	中国太保	5,978,143.97	2.02

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	600000	浦发银行	19,773,683.15	6.68
2	600837	海通证券	17,678,818.79	5.97
3	601328	交通银行	16,053,810.00	5.42
4	600036	招商银行	14,317,842.90	4.84
5	000001	平安银行	10,477,693.46	3.54
6	600015	华夏银行	10,420,830.67	3.52
7	601688	华泰证券	9,621,319.38	3.25
8	601988	中国银行	7,872,039.00	2.66
9	601398	工商银行	7,256,345.00	2.45
10	601818	光大银行	7,111,229.00	2.40



11	601211	国泰君安	6,824,126.54	2.30
12	601318	中国平安	6,493,907.60	2.19
13	601555	东吴证券	6,324,323.90	2.14
14	601166	兴业银行	6,273,706.46	2.12
15	601169	北京银行	5,953,327.88	2.01
16	601601	中国太保	5,758,576.82	1.94
17	000858	五粮液	5,661,798.91	1.91
18	600016	民生银行	5,420,739.62	1.83
19	000783	长江证券	5,347,013.80	1.81
20	601009	南京银行	5,257,032.47	1.78

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	916,463,054.46
卖出股票收入（成交）总额	824,528,914.14

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	66,508.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,287.95
5	应收申购款	488,075.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	565,872.79

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

份额级别	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
华夏沪深 300 指数增强 A	9,632	24,531.91	57,003,754.68	24.12%	179,287,646.96	75.88%
华夏沪深 300 指数增强 C	4,513	18,737.23	9,339.54	0.01%	84,551,763.52	99.99%
合计	14,145	22,683.10	57,013,094.22	17.77%	263,839,410.48	82.23%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华夏沪深 300 指数增强 A	791,199.28	0.33%
	华夏沪深 300 指数增强 C	5,282.36	0.01%
	合计	796,481.64	0.25%

### 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的情况

项目	份额级别	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	华夏沪深 300 指数增强 A	50~100
	华夏沪深 300 指数增强 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏沪深 300 指数增强 A	0
	华夏沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C

基金合同生效日（2015 年 2 月 10 日）基金份额总额	578,687,452.07	109,554,107.34
本报告期期初基金份额总额	168,467,849.12	85,360,829.90
本报告期基金总申购份额	109,960,839.80	37,630,208.47
减：本报告期基金总赎回份额	42,137,287.28	38,429,935.31
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	236,291,401.64	84,561,103.06

## §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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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	
申万宏源证券	1	766,665,120.91	44.14%	713,990.27	44.14%	-
长江证券	1	726,730,321.18	41.84%	676,804.29	41.84%	-

安信证券	1	243,049,880.32	13.99%	226,355.43	13.99%	-
东吴证券	1	641,245.82	0.04%	468.97	0.03%	-

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，本基金还选择了高华证券、光大证券、广发证券、国海证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华泰证券、华西证券、西部证券、中国银河证券、中投证券、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④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
申万宏源证券	67,435.20	100.00%	214,500,000.00	68.51%
长江证券	-	-	-	-
安信证券	-	-	37,000,000.00	11.82%
东吴证券	-	-	61,600,000.00	19.67%

## §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

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

华夏基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日