

华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
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.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	38
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息.....	39
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	40
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	43
§12 备查文件目录.....	43

§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	529,235,487.40 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	372,727,454.63 份	156,508,032.77 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
注册地址	北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031

法定代表人	杨明辉	周慕冰
-------	-----	-----

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	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（2019 年 1 月 1 日至 2019 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	30,294,319.50	10,952,495.56
本期利润	99,310,453.07	35,444,615.59
加权平均基金份额本期利润	0.2832	0.2560
本期加权平均净值利润率	21.24%	19.58%
本期基金份额净值增长率	25.24%	24.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 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	152,483,601.37	59,212,794.83
期末可供分配基金份额利润	0.4091	0.3783
期末基金资产净值	525,211,056.00	215,720,827.60
期末基金份额净值	1.409	1.378
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 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	40.90%	37.80%

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	5.54%	1.16%	5.25%	1.10%	0.29%	0.06%
过去三个月	0.28%	1.50%	-0.77%	1.45%	1.05%	0.05%
过去六个月	25.24%	1.49%	26.46%	1.47%	-1.22%	0.02%
过去一年	10.16%	1.46%	10.01%	1.45%	0.15%	0.01%
过去三年	31.19%	1.05%	24.73%	1.05%	6.46%	0.00%
自基金合同生效起至今	40.90%	1.55%	20.20%	1.50%	20.70%	0.05%

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	5.43%	1.16%	5.25%	1.10%	0.18%	0.06%
过去三个月	0.15%	1.49%	-0.77%	1.45%	0.92%	0.04%
过去六个月	24.93%	1.49%	26.46%	1.47%	-1.53%	0.02%
过去一年	9.54%	1.47%	10.01%	1.45%	-0.47%	0.02%
过去三年	29.27%	1.06%	24.73%	1.05%	4.54%	0.01%
自基金合同生效起至今	37.80%	1.55%	20.20%	1.50%	17.60%	0.05%

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 2019 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、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		
宋洋	本基金的基金经理、数量投资部总监	2016-11-18	-	9 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，华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 24 日至 2018 年 9 月 10 日期间）等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 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 $\times 95\% + 1.5\%$ （指年收益率，评价时应按期间折算）。沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

上半年，国际方面，全球经济增长乏力，5 月全球制造业 PMI 为 49.8，自 2012 年 12 月以来首次落至收缩区间。美国方面，上半年经济整体维持强势，但疲态逐渐显露；2 月非农数据大幅低于预期；3 月下旬美国国债 10 年期与 1 年期收益率出现倒挂，引发市场担忧；5 月美国经济回落态势明显，经济景气指标持续下行；美联储 6 月会议维持利率不变，但暗示了未来降息的可能性。欧洲方面，受全球贸易冲突、英国脱欧的不确定性和民粹主义的再度兴起、意大利财政危机等多方面因素影响，欧元区经济增长持续低迷，制造业 PMI 自 2 月落入收缩区间后持续下行，欧央行政策态度维持鸽派。国内方面，一季度国内经济弱势企稳，但二季度再度减速，二季度 GDP 同比增长 6.2%，

相比于一季度小幅回落 0.2 个百分点；上半年固定资产投资（不含农户）同比增长 5.8%，呈现逐步企稳的态势。分领域看，6 月三大投资领域增速同时反弹，稳投资政策持续落实和加力，对投资的支持作用有所显现；消费方面，二季度消费增速有所回升，上半年社会消费品零售总额名义增长 8.4%，其中必须消费保持稳定，可选消费普遍回升；上半年国内物价走势相对平稳，CPI 延续温和上涨态势，PPI 总体小幅上涨。

市场方面，年初受宏观信贷数据大幅超预期、中美贸易谈判顺利开展等事件的影响，投资者风险偏好有所恢复，再叠加海外资金持续流入，A 股迎来一波明显的上涨，市场成交量显著放大；但随着二季度中美贸易谈判的反复和贸易摩擦的再次升级、国内宏观经济数据疲软回落，股票市场出现一波回调，然后维持震荡走势。

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，积极参与主板打新等确定性收益增厚的投资机会，应对投资者日常申购、赎回等可能对基金带来收益冲击的工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，华夏沪深 300 指数增强 A 基金份额净值为 1.409 元，本报告期份额净值增长率为 25.24%；华夏沪深 300 指数增强 C 基金份额净值为 1.378 元，本报告期份额净值增长率为 24.93%，同期业绩比较基准增长率为 26.46%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为-1.22%，C 类份额跟踪偏离度为-1.53%。

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，全球经济增长将延续回落态势，且在回落中分化加剧；发达经济体内部持续面临民粹主义浪潮冲击、美国发动的贸易摩擦蔓延升级带来贸易保护主义与逆全球化有所抬头、以及地缘政治冲击等多重不确定性因素，将进一步加剧全球经济的波动和不确定性。国内方面，经济受房地产投资后继乏力、制造业投资受挤出和利润压制、外需与贸易摩擦拖累出口三个方面的影响，下半年经济下行压力凸显；但逆周期政策作用下，基建投资的持续回升和消费增速的企稳则会形成托底经济的动力。总体上判断，如果下半年国内经济有所企稳或中美贸易谈判进展超预期，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。投资策略上，我们将继续坚持量化投资的理念，基于多因子模型，在控制组合风险的基础上，持续为投资者实现超越基准指数的超额回报。

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。会计师事务所对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：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%，本基金收益分配方式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

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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遵规守信、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：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	67,839,641.80	27,230,839.62
结算备付金		13,121,080.01	2,528,629.38
存出保证金		3,619,980.60	368,138.65
交易性金融资产	6.4.7.2	664,242,460.25	451,299,858.58
其中：股票投资		664,242,460.25	451,299,858.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	20,000,000.00	3,000,000.00
应收证券清算款		-	43,904.77
应收利息	6.4.7.5	19,726.71	7,750.52
应收股利		-	-
应收申购款		1,427,420.00	709,955.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		770,270,309.37	485,189,076.75
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		20,000,000.00	-
应付赎回款		7,792,320.47	2,338,870.55
应付管理人报酬		590,891.05	412,133.22
应付托管费		118,178.23	82,426.64
应付销售服务费		87,407.23	57,357.17
应付交易费用	6.4.7.7	564,422.46	1,100,238.96
应交税费		48,760.70	1.18
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	136,445.63	95,686.80
负债合计		29,338,425.77	4,086,714.52
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	529,235,487.40	429,934,792.63
未分配利润	6.4.7.10	211,696,396.20	51,167,569.60
所有者权益合计		740,931,883.60	481,102,362.23
负债和所有者权益总计		770,270,309.37	485,189,076.75

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华夏沪深 300 指数增强 A 基金份额净值 1.409 元，华夏沪深 300 指数增强 C 基金份额净值 1.378 元；华夏沪深 300 指数增强基金份额总额 529,235,487.40 份（其中 A 类 372,727,454.63 份，C 类 156,508,032.77 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：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		140,695,732.99	-40,361,941.22
1.利息收入		292,562.09	256,503.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	175,493.33	137,482.34
债券利息收入		924.06	53.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		116,144.70	118,968.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		45,601,470.18	5,085,018.21

其中：股票投资收益	6.4.7.12	34,394,528.61	429,513.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	440,341.54	77,864.20
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	2,269,028.85	109,858.54
股利收益	6.4.7.17	8,497,571.18	4,467,781.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	93,508,253.60	-46,258,062.60
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	1,293,447.12	554,599.40
减：二、费用		5,940,664.33	5,717,065.92
1.管理人报酬		3,205,589.63	2,220,939.40
2.托管费		641,117.98	444,187.97
3.销售服务费		446,769.29	278,196.65
4.交易费用	6.4.7.20	1,454,982.71	2,606,870.20
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		6,809.92	867.30
7.其他费用	6.4.7.21	185,394.80	166,004.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		134,755,068.66	-46,079,007.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		134,755,068.66	-46,079,007.14

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：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）	429,934,792.63	51,167,569.60	481,102,362.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	134,755,068.66	134,755,068.66
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）	99,300,694.77	25,773,757.94	125,074,452.71
其中：1.基金申购款	365,208,809.97	120,782,057.46	485,990,867.43
2.基金赎回款	-265,908,115.20	-95,008,299.52	-360,916,414.72

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）	529,235,487.40	211,696,396.20	740,931,883.60
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）	314,143,930.34	129,951,226.38	444,095,156.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-46,079,007.14	-46,079,007.14
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）	30,436,592.67	10,363,108.07	40,799,700.74
其中：1.基金申购款	162,295,546.96	65,967,646.20	228,263,193.16
2.基金赎回款	-131,858,954.29	-55,604,538.13	-187,463,492.42
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）	344,580,523.01	94,235,327.31	438,815,850.32

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 指数增强型证券投资基金（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[2014]147 号《关于核准华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准、机构部函[2015]70 号《关于华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金延期募集备案的回函》确认，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 指数增强型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。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 1 月 19 日至 2015 年 2 月 6 日期间共募集 688,054,988.40 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 0128 号验资报告予以验证。经向中国证监会

备案,《华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 688,241,559.41 份基金份额,其中认购资金利息折合 186,571.01 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券(含中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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。

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	67,839,641.80
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	67,839,641.80

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	615,129,957.44	664,242,460.25	49,112,502.81
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	615,129,957.44	664,242,460.25	49,112,502.81

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	33,986,904.71	-	-	-
其中：股指期货	33,986,904.71	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	33,986,904.71	-	-	-

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
IF1909	沪深 300 期货 IF1909 合约	31	35,263,740.00	1,276,835.29	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					1,276,835.29
股指期货投资本期收益					2,337,099.71

股指期货投资本期公允价值变动	1,272,560.29
----------------	--------------

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	20,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,000,000.00	-

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	11,094.14
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	6,702.79
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	1,887.68
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	42.10
合计	19,726.71

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	564,422.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	564,422.46

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	9,866.69
预提费用	76,578.94
应付指数使用费	50,000.00
合计	136,445.63

6.4.7.9 实收基金

华夏沪深 300 指数增强 A

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	308,970,679.60	308,970,679.60
本期申购	222,745,519.59	222,745,519.59
本期赎回（以“-”号填列）	-158,988,744.56	-158,988,744.56
本期末	372,727,454.63	372,727,454.63

华夏沪深 300 指数增强 C

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	120,964,113.03	120,964,113.03
本期申购	142,463,290.38	142,463,290.38
本期赎回（以“-”号填列）	-106,919,370.64	-106,919,370.64
本期末	156,508,032.77	156,508,032.77

6.4.7.10 未分配利润

华夏沪深 300 指数增强 A

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	127,092,672.08	-88,422,391.71	38,670,280.37
本期利润	30,294,319.50	69,016,133.57	99,310,453.07
本期基金份额交易产生的变动数	27,174,136.17	-12,671,268.24	14,502,867.93
其中：基金申购款	98,094,424.50	-25,058,966.31	73,035,458.19
基金赎回款	-70,920,288.33	12,387,698.07	-58,532,590.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	184,561,127.75	-32,077,526.38	152,483,601.37

华夏沪深 300 指数增强 C

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	46,800,753.39	-34,303,464.16	12,497,289.23
本期利润	10,952,495.56	24,492,120.03	35,444,615.59
本期基金份额交易产生的变动数	15,142,309.76	-3,871,419.75	11,270,890.01
其中：基金申购款	60,416,451.28	-12,669,852.01	47,746,599.27
基金赎回款	-45,274,141.52	8,798,432.26	-36,475,709.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,895,558.71	-13,682,763.88	59,212,794.83

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	143,397.92
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	31,299.57
其他	795.84
合计	175,493.33

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	682,470,281.87
减：卖出股票成本总额	648,075,753.26
买卖股票差价收入	34,394,528.61

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	4,347,693.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,906,400.00
减：应收利息总额	952.22
买卖债券差价收入	440,341.54

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	2,269,028.85
合计	2,269,028.85

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	8,497,571.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,497,571.18

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	92,235,693.31
——股票投资	92,235,693.31
——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	1,272,560.29
——权证投资	-
——期货投资	1,272,560.29
3.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	93,508,253.60

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	1,293,447.12
合计	1,293,447.12

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	1,454,982.71
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	1,454,982.71

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	19,835.79
信息披露费	56,743.15
银行费用	8,815.86
指数使用费	100,000.00
合计	185,394.80

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（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
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。

6.4.10 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	3,205,589.63	2,220,939.40
其中：支付销售机构的客户维护费	665,998.59	399,446.16

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 1.00%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×1.00%/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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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	641,117.98	444,187.97

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	2019年1月1日至2019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	-	176,544.41	176,544.41
中国农业银行	-	37,171.05	37,171.05
中信证券	-	1,192.86	1,192.86
中信证券（山东）	-	411.52	411.52
中信期货	-	203.62	203.62
华夏财富	-	2,653.78	2,653.78
合计	-	218,177.24	218,177.24
获得销售服务费的各关联方名称	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	-	145,664.29	145,664.29

公司			
中国农业银行	-	36,183.29	36,183.29
中信证券	-	523.84	523.84
中信证券（山东）	-	264.06	264.06
中信期货	-	23.68	23.68
华夏财富	-	1,283.52	1,283.52
合计	-	183,942.68	183,942.68

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 0.50% 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 × 0.50% / 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

无。

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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		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
中国农业银行活期存款	67,839,641.80	143,397.92	24,569,292.56	102,366.23

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。

6.4.10.6 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 205,972,920.00 元（上年度可比期间：222,124,980.00 元），支付给中信期货的佣金为 5,584.22 元（上年度可比期间：7,766.01 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
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

无。

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。

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，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。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开放期内投资者历史申赎、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及比例，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。

本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略。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。

本基金为指数增强型基金，主要采用指数增强量化投资策略，运用多因子分析模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险。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	664,242,460.25	89.65	451,299,858.58	93.81
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	664,242,460.25	89.65	451,299,858.58	93.81

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%	35,361,693.66	22,517,606.44
	-5%	-35,361,693.66	-22,517,606.44

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 2019 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 664,242,460.25 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2018 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 451,299,858.58 元，第二层次的余额为 0 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，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。

6.4.14.4 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	664,242,460.25	86.23
	其中：股票	664,242,460.25	86.23
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	20,000,000.00	2.60
	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	80,960,721.81	10.51

8	其他各项资产	5,067,127.31	0.66
9	合计	770,270,309.37	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	2,847,284.00	0.38
B	采矿业	22,014,254.00	2.97
C	制造业	249,346,198.28	33.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,911,950.00	2.15
E	建筑业	22,178,990.75	2.99
F	批发和零售业	14,790,817.60	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	16,856,946.00	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,363,678.50	0.72
J	金融业	230,797,865.82	31.15
K	房地产业	30,859,537.37	4.16
L	租赁和商务服务业	5,304,213.00	0.72
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	3,608,132.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	619,879,867.32	83.66

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	6,669,665.00	0.90
B	采矿业	1,833,095.25	0.25
C	制造业	13,158,497.28	1.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	894,500.00	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	270,740.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	4,136,077.00	0.56

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,974.86	0.34
J	金融业	447,725.94	0.06
K	房地产业	1,861,898.40	0.25
L	租赁和商务服务业	144,051.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	17,906.20	0.00
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	8,278,177.00	1.12
S	综合	4,161,285.00	0.56
	合计	44,362,592.93	5.99

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

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	578,662	51,275,239.82	6.92
2	600519	贵州茅台	43,946	43,242,864.00	5.84
3	601166	兴业银行	1,353,400	24,753,686.00	3.34
4	000333	美的集团	453,100	23,497,766.00	3.17
5	000858	五粮液	191,300	22,563,835.00	3.05
6	601328	交通银行	2,703,200	16,543,584.00	2.23
7	600837	海通证券	1,127,500	15,999,225.00	2.16
8	601668	中国建筑	2,604,260	14,974,495.00	2.02
9	601211	国泰君安	790,800	14,511,180.00	1.96
10	600276	恒瑞医药	200,060	13,203,960.00	1.78
11	000338	潍柴动力	1,043,300	12,822,157.00	1.73
12	601818	光大银行	3,256,900	12,408,789.00	1.67
13	600016	民生银行	1,729,980	10,985,373.00	1.48
14	000776	广发证券	792,700	10,891,698.00	1.47
15	002415	海康威视	392,800	10,833,424.00	1.46
16	601009	南京银行	1,279,000	10,564,540.00	1.43
17	600031	三一重工	789,500	10,326,660.00	1.39
18	600036	招商银行	285,100	10,257,898.00	1.38
19	600271	航天信息	438,400	10,105,120.00	1.36
20	601006	大秦铁路	1,224,300	9,904,587.00	1.34
21	601601	中国太保	264,700	9,664,197.00	1.30
22	600383	金地集团	806,800	9,625,124.00	1.30
23	600011	华能国际	1,451,100	9,040,353.00	1.22

24	000963	华东医药	326,960	8,487,881.60	1.15
25	600390	五矿资本	866,100	8,167,323.00	1.10
26	002475	立讯精密	326,200	8,086,498.00	1.09
27	601899	紫金矿业	2,092,600	7,889,102.00	1.06
28	600566	济川药业	254,831	7,672,961.41	1.04
29	002146	荣盛发展	812,300	7,627,497.00	1.03
30	000651	格力电器	131,252	7,218,860.00	0.97
31	600606	绿地控股	1,021,900	6,979,577.00	0.94
32	600028	中国石化	1,248,100	6,827,107.00	0.92
33	600886	国投电力	863,900	6,712,503.00	0.91
34	601169	北京银行	1,123,300	6,638,703.00	0.90
35	600585	海螺水泥	159,100	6,602,650.00	0.89
36	300003	乐普医疗	271,800	6,256,836.00	0.84
37	600048	保利地产	475,900	6,072,484.00	0.82
38	600015	华夏银行	784,600	6,041,420.00	0.82
39	601012	隆基股份	239,400	5,532,534.00	0.75
40	601877	正泰电器	234,850	5,422,686.50	0.73
41	002236	大华股份	352,800	5,122,656.00	0.69
42	600352	浙江龙盛	304,300	4,798,811.00	0.65
43	601225	陕西煤业	512,400	4,734,576.00	0.64
44	600170	上海建工	1,258,000	4,730,080.00	0.64
45	601398	工商银行	783,700	4,615,993.00	0.62
46	601888	中国国旅	47,600	4,219,740.00	0.57
47	600000	浦发银行	358,000	4,181,440.00	0.56
48	000063	中兴通讯	123,000	4,001,190.00	0.54
49	600760	中航沈飞	136,900	3,974,207.00	0.54
50	000425	徐工机械	869,000	3,875,740.00	0.52
51	600104	上汽集团	146,700	3,740,850.00	0.50
52	601111	中国国航	386,300	3,696,891.00	0.50
53	600029	南方航空	403,500	3,115,020.00	0.42
54	300498	温氏股份	79,400	2,847,284.00	0.38
55	600977	中国电影	177,800	2,784,348.00	0.38
56	603858	步长制药	104,500	2,692,965.00	0.36
57	600690	青岛海尔	150,100	2,595,229.00	0.35
58	601186	中国铁建	248,685	2,474,415.75	0.33
59	600050	中国联通	400,400	2,466,464.00	0.33
60	601138	工业富联	188,400	2,270,220.00	0.31
61	600038	中直股份	52,400	2,149,448.00	0.29
62	601997	贵阳银行	242,320	2,096,068.00	0.28
63	002024	苏宁易购	181,900	2,088,212.00	0.28
64	601933	永辉超市	184,000	1,878,640.00	0.25
65	601088	中国神华	85,700	1,746,566.00	0.24
66	000568	泸州老窖	21,400	1,729,762.00	0.23

67	600705	中航资本	311,600	1,688,872.00	0.23
68	601336	新华保险	30,500	1,678,415.00	0.23
69	002179	中航光电	44,970	1,504,696.20	0.20
70	600153	建发股份	165,800	1,472,304.00	0.20
71	300033	同花顺	14,700	1,445,892.00	0.20
72	601555	东吴证券	134,600	1,379,650.00	0.19
73	600522	中天科技	148,100	1,358,077.00	0.18
74	601988	中国银行	356,500	1,333,310.00	0.18
75	601788	光大证券	115,900	1,323,578.00	0.18
76	601628	中国人寿	45,500	1,288,560.00	0.17
77	603160	汇顶科技	9,000	1,249,200.00	0.17
78	002271	东方雨虹	51,500	1,166,990.00	0.16
79	002311	海大集团	37,200	1,149,480.00	0.16
80	600309	万华化学	26,800	1,146,772.00	0.15
81	000157	中联重科	187,700	1,128,077.00	0.15
82	002555	三七互娱	71,700	971,535.00	0.13
83	000538	云南白药	11,500	959,330.00	0.13
84	601828	美凯龙	76,800	933,120.00	0.13
85	600332	白云山	22,006	901,585.82	0.12
86	000895	双汇发展	35,100	873,639.00	0.12
87	600999	招商证券	50,700	866,463.00	0.12
88	600176	中国巨石	89,500	852,935.00	0.12
89	300144	宋城演艺	35,600	823,784.00	0.11
90	000703	恒逸石化	57,000	778,620.00	0.11
91	600816	安信信托	147,860	746,693.00	0.10
92	600482	中国动力	28,100	663,722.00	0.09
93	600398	海澜之家	72,200	654,854.00	0.09
94	600704	物产中大	115,300	624,926.00	0.08
95	600438	通威股份	37,400	525,844.00	0.07
96	002032	苏泊尔	6,900	523,227.00	0.07
97	000876	新希望	30,100	522,837.00	0.07
98	000002	万科 A	18,377	511,064.37	0.07
99	603833	欧派家居	4,300	462,766.00	0.06
100	600887	伊利股份	13,500	451,035.00	0.06
101	601857	中国石油	61,700	424,496.00	0.06
102	600741	华域汽车	18,400	397,440.00	0.05
103	600188	兖州煤业	36,100	392,407.00	0.05
104	000627	天茂集团	56,300	365,387.00	0.05
105	002925	盈趣科技	8,435	329,049.35	0.04
106	600570	恒生电子	4,770	325,075.50	0.04
107	600346	恒力石化	26,460	321,753.60	0.04
108	601319	中国人保	32,500	308,425.00	0.04
109	600089	特变电工	35,000	253,750.00	0.03

110	002050	三花智控	23,800	251,090.00	0.03
111	601607	上海医药	13,160	238,854.00	0.03
112	600919	江苏银行	30,600	222,156.00	0.03
113	601238	广汽集团	16,180	176,847.40	0.02
114	600027	华电国际	42,200	159,094.00	0.02
115	600406	国电南瑞	8,300	154,712.00	0.02
116	601992	金隅集团	40,500	152,280.00	0.02
117	002010	传化智联	20,100	151,353.00	0.02
118	600115	东方航空	22,400	140,448.00	0.02
119	600019	宝钢股份	19,300	125,450.00	0.02
120	000709	河钢股份	23,200	69,368.00	0.01
121	300296	利亚德	7,100	55,593.00	0.01
122	601155	新城控股	1,100	43,791.00	0.01

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	601928	凤凰传媒	800,400.00	6,459,228.00	0.87
2	002299	圣农发展	192,900.00	4,884,228.00	0.66
3	600673	东阳光	530,100.00	4,161,285.00	0.56
4	600026	中远海能	637,300.00	4,136,077.00	0.56
5	002110	三钢闽光	402,650.00	3,744,645.00	0.51
6	002478	常宝股份	455,600.00	2,756,380.00	0.37
7	002195	二三四五	591,290.00	2,300,118.10	0.31
8	600622	光大嘉宝	382,320.00	1,861,898.40	0.25
9	002449	国星光电	117,000.00	1,553,760.00	0.21
10	600985	淮北矿业	129,600.00	1,469,664.00	0.20
11	000301	东方盛虹	264,600.00	1,452,654.00	0.20
12	000902	新洋丰	122,600.00	1,315,498.00	0.18
13	603659	璞泰来	25,600.00	1,203,712.00	0.16
14	002746	仙坛股份	77,200.00	1,194,284.00	0.16
15	601900	南方传媒	100,840.00	957,980.00	0.13
16	600757	长江传媒	91,100.00	620,391.00	0.08
17	002458	益生股份	30,300.00	591,153.00	0.08
18	600483	福能股份	62,900.00	538,424.00	0.07
19	600643	爱建集团	43,200.00	413,856.00	0.06
20	600968	海油发展	102,375.00	363,431.25	0.05
21	000543	皖能电力	75,600.00	356,076.00	0.05
22	002440	闰土股份	20,600.00	256,676.00	0.03
23	300082	奥克股份	33,800.00	222,742.00	0.03
24	000719	中原传媒	30,700.00	217,970.00	0.03
25	002221	东华能源	23,900.00	205,779.00	0.03

26	002353	杰瑞股份	7,800.00	180,180.00	0.02
27	300383	光环新网	8,900.00	149,253.00	0.02
28	601718	际华集团	29,500.00	115,345.00	0.02
29	600138	中青旅	7,100.00	90,099.00	0.01
30	300782	卓胜微	743.00	80,927.56	0.01
31	002572	索菲亚	4,000.00	74,240.00	0.01
32	002867	周大生	1,900.00	64,961.00	0.01
33	002643	万润股份	5,500.00	55,550.00	0.01
34	002127	南极电商	4,800.00	53,952.00	0.01
35	601100	恒立液压	1,600.00	50,208.00	0.01
36	601698	中国卫通	10,103.00	39,603.76	0.01
37	603863	松炆资源	1,612.00	37,204.96	0.01
38	601236	红塔证券	9,789.00	33,869.94	0.00
39	300594	朗进科技	721.00	31,803.31	0.00
40	603867	新化股份	1,045.00	26,971.45	0.00
41	600373	中文传媒	1,800.00	22,608.00	0.00
42	300284	苏交科	1,940.00	17,906.20	0.00

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	600519	贵州茅台	33,863,188.69	7.04
2	601166	兴业银行	18,490,690.00	3.84
3	000333	美的集团	17,809,235.20	3.70
4	601668	中国建筑	16,912,560.05	3.52
5	601318	中国平安	16,615,472.15	3.45
6	600276	恒瑞医药	14,598,782.46	3.03
7	601328	交通银行	14,379,183.35	2.99
8	000338	潍柴动力	12,856,980.70	2.67
9	600886	国投电力	12,646,058.00	2.63
10	601899	紫金矿业	11,777,313.00	2.45
11	600048	保利地产	10,249,429.00	2.13
12	600011	华能国际	10,099,422.70	2.10
13	600271	航天信息	10,078,108.87	2.09
14	601988	中国银行	9,976,493.00	2.07
15	000963	华东医药	9,346,149.70	1.94
16	600016	民生银行	9,098,071.99	1.89
17	600000	浦发银行	8,956,656.12	1.86
18	002195	二三四五	8,534,553.14	1.77
19	601398	工商银行	8,527,215.95	1.77
20	000002	万科 A	8,501,187.39	1.77

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	22,610,965.34	4.70
2	601988	中国银行	20,772,952.37	4.32
3	600900	长江电力	17,439,018.16	3.62
4	600741	华域汽车	16,611,086.00	3.45
5	601607	上海医药	13,238,281.39	2.75
6	000568	泸州老窖	12,454,783.12	2.59
7	601166	兴业银行	10,500,443.27	2.18
8	000858	五粮液	10,469,758.75	2.18
9	600036	招商银行	10,461,984.13	2.17
10	601328	交通银行	10,112,964.00	2.10
11	600332	白云山	9,636,780.12	2.00
12	600383	金地集团	9,307,095.58	1.93
13	601997	贵阳银行	8,915,081.00	1.85
14	601186	中国铁建	8,769,702.47	1.82
15	601138	工业富联	8,603,077.58	1.79
16	600023	浙能电力	8,541,692.74	1.78
17	000002	万科 A	8,417,727.77	1.75
18	002415	海康威视	8,263,929.31	1.72
19	001979	招商蛇口	8,201,308.18	1.70
20	002195	二三四五	8,152,624.34	1.69

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	768,782,661.62
卖出股票收入（成交）总额	682,470,281.87

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
IF1909	沪深 300 期货 IF1909 合约	31	35,263,740.00	1,276,835.29	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					1,276,835.29
股指期货投资本期收益					2,337,099.71
股指期货投资本期公允价值变动					1,272,560.29

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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	3,619,980.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,726.71
5	应收申购款	1,427,420.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,067,127.31

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	23,785	15,670.69	47,432,687.10	12.73%	325,294,767.53	87.27%
华夏沪深 300 指数增强 C	15,529	10,078.44	-	-	156,508,032.77	100.00%
合计	39,314	13,461.76	47,432,687.10	8.96%	481,802,800.30	91.04%

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	664,827.89	0.18%
	华夏沪深 300 指数增强 C	33,789.27	0.02%
	合计	698,617.16	0.13%

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	10~50
	华夏沪深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50
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	0~10
	华夏沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0~10

§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	308,970,679.60	120,964,113.03
本报告期基金总申购份额	222,745,519.59	142,463,290.38
减：本报告期基金总赎回份额	158,988,744.56	106,919,370.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	372,727,454.63	156,508,032.77

§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。

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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	
方正证券	2	1,406,977,597.96	97.04%	606,833.27	95.09%	-
广发证券	1	42,884,481.29	2.96%	31,361.33	4.91%	-

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，本基金还选择了安信证券、申万宏源证券、华创证券、华泰证券、长江证券、东吴证券、新时代证券、联讯证券、华西证券、海通证券、国信证券、财富证券、高华证券、光大证券、国海证券、国泰君安证券、西部证券、中国银河证券、长城证券、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在上述租用的券商交易单元中，海通证券的部分交易单元，华创证券、长城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
方正证券	4,347,693.76	100.00%	1,191,400,000.00	100.00%
广发证券	-	-	-	-

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旗下部分开放式基金新增腾安基金销售(深圳)有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-17
2	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中泰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	2019-02-18
3	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
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增华融湘江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	2019-03-04
5	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
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增玄元保险代理有限公司为代销机构	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09

	的公告		
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在嘉实财富管理有限公司开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-13
8	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

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。

§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 指数增强型证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏沪深 300 指数增强型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