

**华夏沪港通上证 50AH 优选指数  
证券投资基金（LOF）  
2019 年半年度报告摘要  
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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十九日

## §1 重要提示

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。

基金托管人中国建设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。

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	华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	华夏上证 50AH 优选指数（LOF）	
场内简称	50AH	
基金主代码	501050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 月 27 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,042,478,585.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏上证 50AH 优选指数（LOF）A	华夏上证 50AH 优选指数 C
下属分级基金的交易代码	501050	006395
报告期末下属分级基金的份额总额	1,041,999,114.94 份	479,470.59 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证 50AH 优选指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	田国立

## 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 (2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日)	
	华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A	华夏上证 50AH 优选指数 C
本期已实现收益	27,056,069.79	10,787.56
本期利润	225,856,604.36	56,734.52
加权平均基金份额本期利润	0.2366	0.1618
本期加权平均净值利润率	19.60%	13.35%
本期基金份额净值增长率	23.09%	22.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A	华夏上证 50AH 优选指数 C
期末可供分配利润	141,963,640.88	63,974.42
期末可供分配基金份额利润	0.1362	0.1334
期末基金资产净值	1,344,348,774.18	616,653.40
期末基金份额净值	1.290	1.286
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A	华夏上证 50AH 优选指数 C
基金份额累计净值增长率	29.00%	14.72%

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

华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) 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	6.97%	1.16%	5.85%	1.14%	1.12%	0.02%
过去三个月	3.28%	1.23%	1.84%	1.21%	1.44%	0.02%
过去六个月	23.09%	1.29%	21.82%	1.28%	1.27%	0.01%
过去一年	16.53%	1.37%	14.11%	1.36%	2.42%	0.01%
自基金合同生效起至今	29.00%	1.10%	25.59%	1.11%	3.41%	-0.01%

华夏上证 50AH 优选指数 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	6.90%	1.16%	5.85%	1.14%	1.05%	0.02%
过去三个月	3.21%	1.25%	1.84%	1.21%	1.37%	0.04%
过去六个月	22.83%	1.29%	21.82%	1.28%	1.01%	0.01%
自基金合同生效起至今	14.72%	1.41%	14.15%	1.39%	0.57%	0.02%

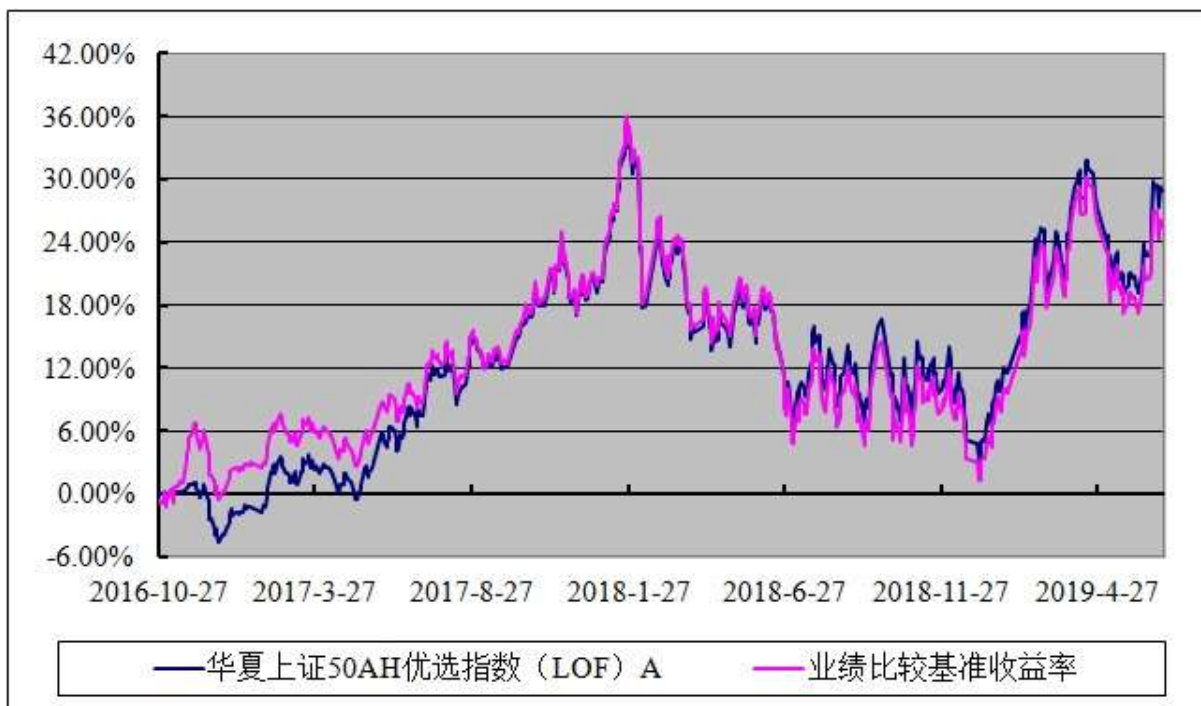
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金 (LOF)

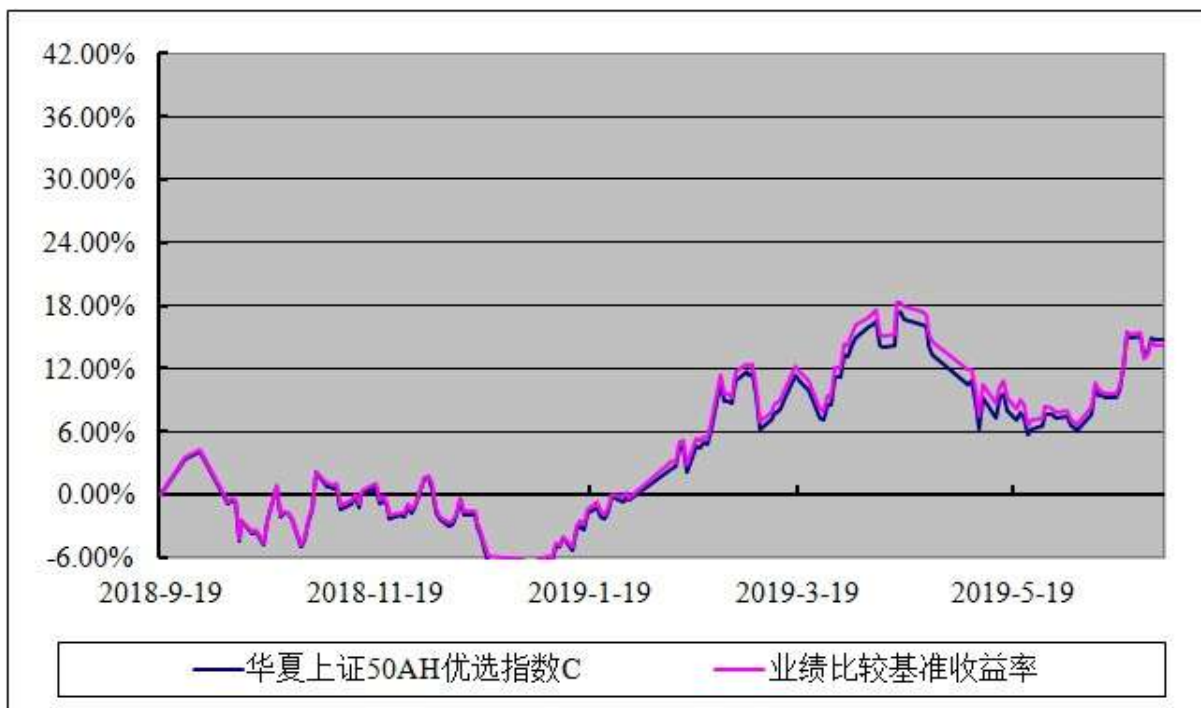
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 10 月 27 日至 2019 年 6 月 30 日)

华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A



华夏上证 50AH 优选指数 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		
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2016-10-27	-	9 年	北京大学光华管理学院会计学硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理，MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 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上证 50AH 优选指数, 业绩比较基准为: 上证 50AH 优选指数收益率  $\times 95\%$  + 银行活期存款利率 (税后)  $\times 5\%$ 。上证 50AH 优选指数反映上证 50 指数使用 AH 价差投资策略的整体表现, 为投资者提供建立在上证 50 基础上的额外回报。该指数自 2015 年 12 月起正式发布, 截至 2019 年 6 月 30 日, 该指数成份股样本共计 50 只, 其中 A 股 21 只, 港股 29 只。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数, 实现基金投资目标。

2019 年上半年, 世界经济增长、国际贸易增长动能继续放缓, 下行压力倍增, 海外货币政策取向已有所松动, 美联储释放出更多鸽派信号, 降息概率明显上升, 部分新兴市场国家已经进入降息通道。国内方面, 1 季度政策全面放松, 央行释放流动性, 宽货币向宽信用传导出现良好迹象。绝大多数宏观经济指标的表现比较平稳, 一部分指标趋势向好, 从投资、消费数据来看, 国内需求呈现稳中有升的态势; 从生产端及需求端数据来看, 3 月制造业 PMI 超预期回升, 重回荣枯线上方, 经济结构优化的趋势在延续。2 季度中美贸易冲突升级并延伸至技术、金融领域, 中国经济面临来自外围环境的压力。国内货币政策维持平稳, 部分中小银行同业风险对金融市场信用偏好造成不利影响, 后央行批量调整头部券商短融余额上限, 以此传导流动性, 市场压力得到缓解。从总的情况

来看,无论是经济的增长和就业,还是物价和国际收支这四大指标,中国经济运行保持在合理区间,今年以来总体表现平稳,增长动力加快转换。

市场方面,在经历了 2018 年的大跌之后,1 季度 A 股市场喜迎开门红,上证综指快速反弹至 3000 点上方,沪深两市成交金额突破了万亿元。政策环境转暖、外资等长期资金涌入等促使 A 股市场投资者情绪逐步高涨,估值低、弹性较大的中小盘风格指数补涨反弹势力最为强劲。4 月 A 股指数在流动性修复边际递减、中美贸易摩擦等因素下出现一定幅度回调。而后,在国内经济金融领域结构调整积极变化预期下,以及 MSCI 和 FTSE 提高 A 股在全球股票指数占比,北向资金加速流入 A 股布局等因素作用下,市场信心得到修复,A 股指数再度企稳回升。香港市场受发达市场和内地市场的双重影响,1 季度中美股市均大幅反弹,中美贸易摩擦趋向缓和,故港股也呈现出较强的反弹力度。2 季度受中美贸易摩擦升级的影响,中国香港市场出现较大幅度地下跌,随后随着全球主要央行货币政策转向宽松,中国香港市场出现反弹。整体而言,2019 年上半年 A 股对 H 股的溢价率较年初有一定幅度的上升。

基金投资运作方面,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、赎回及成份股调整等工作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日,华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A 基金份额净值为 1.290 元,本报告期份额净值增长率为 23.09%;华夏上证 50AH 优选指数 C 基金份额净值为 1.286 元,本报告期份额净值增长率为 22.83%,同期业绩比较基准增长率为 21.82%。

#### 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 2019 年下半年,全球经济前景面临的主要风险来自于贸易谈判的结果和未来几个月金融市场情绪变化的方向。国际方面,在经济增长触顶的推动下,美联储货币政策或将自 2015 年底长时间加息通道后发生转向,美股存在变化及其回落风险;而以欧元区为代表的主要发达经济体的经济则仍大概率持续低迷。国内方面,经济发展的外部环境仍旧复杂严峻,国内的结构性矛盾仍然突出,政策层面或将持续托底,维护增速稳定,但全面货币政策宽松的可能性亦较低。

目前 A 股估值处于合理水平,但部分上市公司盈利增速下滑尚未企稳,市场震荡企稳过程中,符合经济转型方向的板块已逐步迎来中长线投资窗口。此外,外资增配 A 股的整体大趋势不变,2019 年下半年更多的海外资金仍将持续流入 A 股市场,龙头中盘股受到边际增量资金推动效应将尤为明显,科创板的推出有望加速 A 股改革进程,实现科技、资本和实体经济的良性循环,对市场情绪起到持续提振效用。而目前港股市场的估值水平处在历史较低水平,具备良好的投资价值,如有国内经济企稳回升,H 股有望在中国股票整体增配的推动下震荡上行,若经济下滑超预期,市场则会延

续震荡走势，本基金采用 AH 股价差策略，在当前市场环境下具备较强相对优势。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同规定，本基金的收益分配原则为：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 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 50%。本基金场外份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。本基金场内份额的收益分配方式仅能为现金分红，具体权益分派程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。当基金累计报酬率超过同期上证 50 指数累计报酬率达到 1% 以上，可进行收益分配。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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## §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：华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金 (LOF)

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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款		78,835,004.57	63,396,165.43
结算备付金		23,877,633.38	8,035,836.57
存出保证金		5,175,827.36	3,350,725.97
交易性金融资产		1,248,500,510.02	842,530,579.15
其中：股票投资		1,248,500,510.02	842,184,579.15
基金投资		-	-
债券投资		-	346,000.00
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		-	-
应收证券清算款		1,418,157.57	-
应收利息		133,981.20	59,192.38
应收股利		9,249,458.93	-
应收申购款		1,731,342.08	-
递延所得税资产		-	-

其他资产		-	-
资产总计		1,368,921,915.11	917,372,499.50
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		17,818,236.22	75.27
应付赎回款		4,947,945.27	-
应付管理人报酬		527,224.67	391,250.94
应付托管费		105,444.92	78,250.22
应付销售服务费		195.19	92.84
应付交易费用		390,339.07	258,661.02
应交税费		5,587.53	0.62
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		161,514.66	120,000.00
负债合计		23,956,487.53	848,330.91
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金		1,042,478,585.53	874,585,014.11
未分配利润		302,486,842.05	41,939,154.48
所有者权益合计		1,344,965,427.58	916,524,168.59
负债和所有者权益总计		1,368,921,915.11	917,372,499.50

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A 基金份额净值为 1.290 元，华夏上证 50AH 优选指数 C 基金份额净值为 1.286 元；华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) 基金份额总额 1,042,478,585.53 份（其中 A 类 1,041,999,114.94 份，C 类 479,470.59 份。）

## 6.2 利润表

会计主体：华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金 (LOF)

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	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
<b>一、收入</b>		230,304,224.87	-63,058,376.27
1.利息收入		399,876.60	224,086.22
其中：存款利息收入		399,100.56	222,064.30
债券利息收入		776.04	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,021.92
其他利息收入		-	-
<b>2.投资收益 (损失以“-”填列)</b>		<b>30,344,979.27</b>	<b>10,851,619.59</b>
其中: 股票投资收益		3,881,233.55	1,291,183.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益		171,482.99	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		2,784,433.66	-1,478,849.81
股利收益		23,507,829.07	11,039,285.60
<b>3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)</b>		<b>198,846,481.53</b>	<b>-74,771,875.69</b>
4.汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)		712,887.47	637,793.61
<b>减: 二、费用</b>		<b>4,390,885.99</b>	<b>3,151,684.04</b>
1.管理人报酬		2,861,286.82	1,515,184.28
2.托管费		572,257.38	303,036.86
3.销售服务费		839.57	-
4.交易费用		738,938.32	1,156,065.34
5.利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		8,355.66	2,049.56
7.其他费用		209,208.24	175,348.00
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>225,913,338.88</b>	<b>-66,210,060.31</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>225,913,338.88</b>	<b>-66,210,060.31</b>

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金 (LOF)

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)	874,585,014.11	41,939,154.48	916,524,168.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	225,913,338.88	225,913,338.88
三、本期基金份额交易产	167,893,571.42	34,634,348.69	202,527,920.11

生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	397,883,666.44	84,386,976.26	482,270,642.70
2.基金赎回款	-229,990,095.02	-49,752,627.57	-279,742,722.59
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)	1,042,478,585.53	302,486,842.05	1,344,965,427.58
项目	上上年度可比期间		
	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)	362,210,771.98	73,247,533.87	435,458,305.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-66,210,060.31	-66,210,060.31
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)	307,624,529.32	64,494,464.19	372,118,993.51
其中: 1.基金申购款	420,669,647.74	89,007,036.11	509,676,683.85
2.基金赎回款	-113,045,118.42	-24,512,571.92	-137,557,690.34
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)	669,835,301.30	71,531,937.75	741,367,239.05

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 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
中国建设银行股份有限公司 (“中国建设银行”)	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
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。

6.4.4 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	-	-	698,710,871.73	100.00%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	-	-	2,000,000.00	100.00%

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期



	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	-	-	-	-
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	673,437.82	100.00%	435,393.66	75.27%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 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	2,861,286.82	1,515,184.28
其中：支付销售机构的客户维护费	735,757.63	249,040.97

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	572,257.38	303,036.86

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 0.10% 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 × 0.10% / 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 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		
	华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A	华夏上证 50AH 优选指数 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	766.60	766.60
华夏财富	-	72.97	72.97
合计	-	839.57	839.57
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		
	华夏上证50AH优选指数 (LOF) A	华夏上证50AH优选指数 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	-	-
华夏财富	-	-	-
合计	-	-	-

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 0.4% 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 × 0.4% / 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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	
	华夏上证50AH优选指数 (LOF) A	华夏上证50AH优选指数C	华夏上证50AH优选指数 (LOF) A	华夏上证50AH优选指数C
期初持有的基金	-	-	-	-

份额				
期间申购/买入总份额	19,600.00	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	19,600.00	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-	-	-

注：本基金管理人于本报告期申购本基金，适用费率为 0.03%。

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	78,835,004.57	287,610.19	45,916,679.00	148,217.47

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

6.4.4.7.1 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 180,690,060.00 元（上年度可比期间：358,084,800.00 元），支付给中信期货的佣金为 5,845.49 元（上年度可比期间：15,315.60 元）。

6.4.5 期末（2019 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

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	-
--------	------	------------	------------	----------------	------	------	-------	-----------	-----------	---

#### 6.4.5.2 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 (单位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
600485	*ST 信威	2016-12-26	重大事项	5.76	2019-07-12	13.86	147,385	2,144,883.14	848,937.60	-

#### 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 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 1,247,651,572.42 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 848,937.60 元。（截至 2018 年 12 月 31 日止，第一层次的余额为 842,530,579.15 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

本基金持有的部分股票投资于本报告期转入第三层次，转入金额为 848,937.60 元，转入第三层次后的变动均为计入当期损益的未实现损失，计入利润表中的公允价值变动收益项目。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,248,500,510.02	91.20
	其中：股票	1,248,500,510.02	91.20
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	-	-
	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	102,712,637.95	7.50
8	其他各项资产	17,708,767.14	1.29
9	合计	1,368,921,915.11	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 516,325,295.20 元，占基金资产净值比例为 38.39%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	363,431.25	0.03
C	制造业	320,653,059.41	23.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	26,935,300.00	2.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,841,315.76	0.95
J	金融业	318,655,575.55	23.69
K	房地产业	33,415,992.00	2.48
L	租赁和商务服务业	19,310,540.85	1.44
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	732,175,214.82	54.44

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (人民币)	占基金资产净值比例 (%)
金融	403,813,623.22	30.02
工业	55,111,103.64	4.10
能源	43,350,524.46	3.22
保健	7,779,457.94	0.58
材料	6,270,585.94	0.47
通信服务	-	-
公用事业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
房地产	-	-
信息技术	-	-
合计	516,325,295.20	38.39

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

### 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

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	2,417,491	214,213,877.51	15.93
2	600519	贵州茅台	112,141	110,346,744.00	8.20
3	03968	招商银行	2,397,000	82,127,828.53	6.11

4	601166	兴业银行	3,245,200	59,354,708.00	4.41
5	600276	恒瑞医药	690,956	45,603,096.00	3.39
6	600887	伊利股份	1,360,685	45,460,485.85	3.38
7	06030	中信证券	2,814,500	40,306,073.98	3.00
8	03328	交通银行	6,862,000	35,794,825.64	2.66
9	01988	民生银行	6,958,700	33,116,179.13	2.46
10	01288	农业银行	11,414,000	32,832,236.31	2.44

注：①所用证券代码采用当地市场代码。

②投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

#### 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	601318	中国平安	35,053,116.04	3.82
2	06837	海通证券	24,273,316.85	2.65
3	00386	中国石油化工股份	19,624,534.86	2.14
4	600519	贵州茅台	18,098,461.45	1.97
5	600031	三一重工	17,017,630.47	1.86
6	601166	兴业银行	16,748,853.00	1.83
7	600028	中国石化	15,289,524.00	1.67
8	03968	招商银行	13,963,526.99	1.52
9	600276	恒瑞医药	12,213,289.88	1.33
10	06030	中信证券	11,282,130.18	1.23
11	01288	农业银行	8,355,457.29	0.91
12	01088	中国神华	8,054,779.72	0.88
13	600887	伊利股份	7,523,403.00	0.82
14	03328	交通银行	6,898,530.67	0.75
15	00753	中国国航	6,382,705.77	0.70
16	01988	民生银行	6,292,481.23	0.69
17	02611	国泰君安	5,788,464.04	0.63
18	600000	浦发银行	5,727,963.56	0.62
19	601668	中国建筑	5,510,031.43	0.60
20	02601	中国太保	5,117,880.24	0.56

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	601169	北京银行	20,578,220.40	2.25
2	600028	中国石化	15,600,730.00	1.70
3	00386	中国石油化工股份	14,671,407.98	1.60
4	601318	中国平安	12,942,656.64	1.41
5	601006	大秦铁路	11,927,206.86	1.30
6	600519	贵州茅台	6,529,839.48	0.71
7	600606	绿地控股	5,841,828.00	0.64
8	01787	山东黄金	5,712,528.57	0.62
9	600887	伊利股份	2,561,277.11	0.28
10	600000	浦发银行	2,049,398.00	0.22
11	601360	三六零	2,027,349.62	0.22
12	601668	中国建筑	1,884,214.00	0.21
13	601166	兴业银行	1,776,305.00	0.19
14	03328	交通银行	1,729,801.94	0.19
15	603259	药明康德	1,525,683.00	0.17
16	03968	招商银行	1,464,819.27	0.16
17	600309	万华化学	1,446,598.00	0.16
18	600104	上汽集团	1,402,903.00	0.15
19	600048	保利地产	1,392,677.00	0.15
20	01186	中国铁建	1,267,078.98	0.14

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

买入股票的成本（成交）总额	339,162,303.13
卖出股票的收入（成交）总额	133,971,334.01

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
IH1907	上证 50 股指期货 IH1907 合约	21	18,351,900.00	346,620.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IH1909	上证 50 股指期货 IH1909 合约	7	6,098,400.00	317,340.00	买入股指期货多头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					663,960.00
股指期货投资本期收益					2,784,433.66
股指期货投资本期公允价值变动					1,602,753.33

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司、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	5,175,827.36
2	应收证券清算款	1,418,157.57
3	应收股利	9,249,458.93
4	应收利息	133,981.20
5	应收申购款	1,731,342.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,708,767.14

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
华夏上证 50AH 优选指数(LOF) A	127,370	8,180.88	23,801,577.47	2.28%	1,018,197,537.47	97.72%
华夏上证 50AH 优选指数 C	54	8,879.09	-	-	479,470.59	100.00%
合计	127,424	8,181.18	23,801,577.47	2.28%	1,018,677,008.06	97.72%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例

1	国信证券股份有限公司	4,840,321.00	1.44%
2	罗国荣	4,812,732.00	1.43%
3	张恭继	3,849,334.00	1.15%
4	芜湖歌斐资产管理有限公司—歌斐诺亚家族专享组合 5 号联接基金	3,610,627.00	1.08%
5	工银瑞信基金—交通银行—交银国际信托—交银国信 汇利 180 号集合资金信托	2,692,300.00	0.80%
6	童恺	2,300,900.00	0.69%
7	梁向科	2,000,000.00	0.60%
8	郑晖	1,777,940.00	0.53%
9	童娇	1,498,604.00	0.45%
10	王潍东	1,270,000.00	0.38%

### 8.3 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	华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A	80,309.13	0.01%
	华夏上证 50AH 优选指数 C	26.76	0.01%
	合计	80,335.89	0.01%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A	0
	华夏上证 50AH 优选指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A	0
	华夏上证 50AH 优选指数 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) A	华夏上证 50AH 优选指数 C
----	------------------------	------------------

基金合同生效日 (2016 年 10 月 27 日) 基金份额总额	682,253,095.50	-
本报告期期初基金份额总额	874,229,240.58	355,773.53
本报告期基金总申购份额	397,152,584.36	731,082.08
减: 本报告期基金总赎回份额	229,382,710.00	607,385.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,041,999,114.94	479,470.59

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本基金托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告, 聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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	456,171,080.37	96.57%	346,633.29	95.68%	-
申万宏源证券	2	16,225,742.80	3.43%	15,666.84	4.32%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

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，本基金还选择了爱建证券、安信证券、财富里昂、东吴证券、高华证券、广发证券、广州证券、国联证券、国泰君安、国信证券、华宝证券、华福证券、华融证券、华鑫证券、上海证券、太平洋证券、天风证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、银河证券、长城证券、中投证券、中信建投、中信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，长城证券、安信证券、中信证券的部分交易单元为本基金本期新增的券商交易单元。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	1,588,602.70	56.15%	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-
中金公司	1,240,701.17	43.85%	-	-

## §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

二〇一九年八月二十九日