

华夏领先股票型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十九日

§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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
§2 基金简介	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	5
§5 托管人报告	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
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	37
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	39
§10 重大事件揭示	40
§11 影响投资者决策的其他重要信息	42
§12 备查文件目录	42

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏领先股票型证券投资基金
基金简称	华夏领先股票
基金主代码	001042
交易代码	001042
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 15 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,432,547,455.67 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握经济发展趋势和市场运行特征，挖掘经济发展过程中具有领先优势的企业，追求基金资产的长期、持续增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×90%+上证国债指数×10%。
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，属于较高风险、较高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	95588
传真	010-63136700	010-66105798
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	杨明辉	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	185,783,182.58
本期利润	330,993,520.60
加权平均基金份额本期利润	0.1262
本期加权平均净值利润率	19.60%
本期基金份额净值增长率	21.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-889,110,511.83
期末可供分配基金份额利润	-0.3655
期末基金资产净值	1,787,528,524.40
期末基金份额净值	0.735
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-26.50%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.53%	1.06%	6.88%	0.81%	4.65%	0.25%
过去三个月	23.95%	1.22%	11.68%	0.81%	12.27%	0.41%
过去六个月	21.29%	1.73%	1.90%	1.37%	19.39%	0.36%

过去一年	35.86%	1.36%	8.67%	1.10%	27.19%	0.26%
过去三年	-0.41%	1.41%	14.18%	1.13%	-14.59%	0.28%
自基金合同生效起至今	-26.50%	1.86%	-7.27%	1.37%	-19.23%	0.49%

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

华夏领先股票型证券投资基金

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 5 月 15 日至 2020 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中

日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 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、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品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，2020 年在基金分类排名中（截至 2020 年 6 月 30 日数据），华夏双债债券(C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（非 A 类）”中排序 1/123；华夏鼎利债券 (A 类)和华夏鼎沛债券 (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）”中分别排序 2/248 和 6/248；华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金（A 类）”中排序 2/345；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 9/22；华夏创新前沿股票和华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 2/203 和 10/203；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 1/10；华夏医疗健康混合(A 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（A 类）”中排序 5/225；华夏乐享健康混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）”中排序 5/490；华夏磐泰混合(LOF)在“混合基金-偏债型基金-偏债型基金（A 类）”中分别排序 6/125；华夏移动互联混合（QDII）和华夏新时代混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 4/36 和 7/36；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数(C 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（非 A 类）”中排序 6/21，华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 3/78；华夏消费 ETF 及华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 7/35 和 4/35；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 5/53；华夏创成长

ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策略指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/17 和 3/17；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 9/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 3/28。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在中国证券报举办的第十七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，华夏上证 50ETF 荣获“三年期开放式指数型持续优胜金牛基金”奖。在证券时报社主办，在晨星资讯、上海证券和济安金信提供数据和研究支持的第十五届中国基金业明星基金奖评选中，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司”，华夏回报混合荣获“五年持续回报绝对收益策略明星基金”。

在客户服务方面，2020 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）华夏基金管家客户端部分基金上线定投止盈功能，同时对资料上传功能进行升级优化，为广大投资者管理定期定额交易、以及业务办理提供了便利；（2）华夏基金微信公众号上线货币基金收益播报推送功能，方便客户及时了解持有的货币基金收益变动情况；（3）与苏州农商银行、渤海银行、中天证券等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“难忘，因为不用记”、“凡是家人，都有户口本”、“人未动，心已跳”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		
王晓李	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2018-01-17	2020-03-02	12 年	复旦大学产业经济学硕士。曾任东方证券股份有限公司分析师等。2011 年 5 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、华夏领先股票型证券投资基金基金经理（2015 年 9 月 1 日至 2016 年 9 月 14 日期间）等。
林晶	本基金的基金经理、投资研究部执行总经理	2019-01-14	-	15 年	清华大学经济学硕士。2005 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员、基金经理助理、总经理助理、副总经理，华夏兴和混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 17 日至 2019 年 3 月 21 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。

③根据本基金管理人发布的《华夏基金管理有限公司关于调整华夏领先股票型证券投资基金基金经理的公告》，自 2020 年 7 月 21 日起，刘平女士担任本基金基金经理，林晶女士不再担任本基金基金经理。

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，本基金管理人严格执行了《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

疫情的全球蔓延、防控及反复，以及其带来的经济衰退与复苏、国际关系的紧张与重构，是影响今年资本市场大势与结构的主要矛盾。今年上半年，随着新冠疫情的爆发及全球蔓延，全球主要国家均采取了各种疫情防控手段，全球主要经济体经济增速大幅下滑。为了应对这一冲击，全球主要央行相继采取了超常规的货币政策，全球货币环境显著宽松。同时，随着疫情的逐渐平稳，各国也先后开始了复工复产计划，二季度以来，全球经济明显复苏。在这一复苏过程中，由于良好的疫情防控效果和行之有效的常态化防控手段，国内疫后复苏进程相对更为顺利，经济复苏节奏引领全球。

宽松的流动性环境和良好的疫后复苏态势共同构成了国内权益市场上行的基础，在上半年，阶

阶段性受益于疫情及管控措施的必选消费、检测试剂、防疫物资、在线办公、在线娱乐、生鲜超市等领域，以及出现明显复苏或受益于“六保六稳”政策的免税、新能源车、光伏、建材，和在中美关系不确定性日渐增强环境下的自主可控领域都有较为明显的上涨。

本基金在风格上坚持对标中证 500 指数，在上半年，重点配置了云计算、半导体等科技成长以及新能源车、光伏等方向，基于“风格-景气”分析更加侧重于长期方向中景气受益领域。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.735 元，本报告期份额净值增长率为 21.29%，同期业绩比较基准增长率为 1.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国内层面看，下半年流动性环境总体上仍以宽松为主，我国金融改革的步伐加快，随着经济数据的改善和企业盈利预测的上修，都有利于提升权益市场的风险偏好。但是从外部环境看，有一些不确定的风险也需要释放，同时美国疫情反复和非洲疫情加剧，都给外需造成了压力。我们认为下半年的市场机会会更加聚焦在业绩的确定性上，尤其是中长期增长稳定的成长股上，同时随着国内外经济复苏的持续，也有可能给顺经济周期的板块带来一波估值修复的机会。我们在这两类投资机会上的配置，以第一类的成长股为主，集中在云计算、新能源车、消费电子、军工科技等行业上，并将适当把握周期复苏的机会。

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，本基金管理人作为准确、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

本报告期内，本基金托管人在对华夏领先股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华夏领先股票型证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏领先股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华夏领先股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏领先股票型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏领先股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	103,865,011.96	137,113,593.71
结算备付金		45,439,494.87	1,077,575.67
存出保证金		347,657.58	176,511.31
交易性金融资产	6.4.7.2	1,550,942,098.00	1,619,524,377.54
其中：股票投资		1,550,319,962.00	1,552,633,498.24
基金投资		-	-

债券投资		622,136.00	66,890,879.30
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	90,000,000.00	48,950,193.43
应收证券清算款		44,378,790.75	-
应收利息	6.4.7.5	56,255.37	1,834,183.30
应收股利		-	-
应收申购款		854,441.35	316,034.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,835,883,749.88	1,808,992,469.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		33,223,369.15	68,987,101.59
应付赎回款		9,669,816.16	6,578,105.46
应付管理人报酬		2,112,680.66	2,157,606.25
应付托管费		352,113.49	359,601.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,850,954.04	2,213,425.70
应交税费		49,631.07	2.48
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	96,660.91	193,190.42
负债合计		48,355,225.48	80,489,032.97
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	2,432,547,455.67	2,852,504,114.61
未分配利润	6.4.7.10	-645,018,931.27	-1,124,000,677.97
所有者权益合计		1,787,528,524.40	1,728,503,436.64
负债和所有者权益总计		1,835,883,749.88	1,808,992,469.61

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.735 元，基金份额总额 2,432,547,455.67 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏领先股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		351,724,759.61	307,509,031.56
1.利息收入		1,803,323.38	1,578,793.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	419,462.54	359,873.95
债券利息收入		753,466.87	1,213,901.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		630,393.97	5,017.93
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		204,523,606.82	105,316,089.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	193,361,038.39	88,825,151.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	184,128.40	-161,202.94
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	4,825,126.22	-
股利收益	6.4.7.17	6,153,313.81	16,652,141.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	145,210,338.02	200,426,151.09
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	187,491.39	187,997.40
减：二、费用		20,731,239.01	17,130,664.03
1.管理人报酬		12,614,319.12	12,531,613.04
2.托管费		2,102,386.59	2,088,602.10
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	5,880,246.87	2,391,616.09
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		14,477.77	0.52
7.其他费用	6.4.7.21	119,808.66	118,832.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		330,993,520.60	290,378,367.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		330,993,520.60	290,378,367.53

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏领先股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	2,852,504,114.61	-1,124,000,677.97	1,728,503,436.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	330,993,520.60	330,993,520.60
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）	-419,956,658.94	147,988,226.10	-271,968,432.84
其中：1.基金申购款	113,229,284.10	-40,852,192.37	72,377,091.73
2.基金赎回款	-533,185,943.04	188,840,418.47	-344,345,524.57
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）	2,432,547,455.67	-645,018,931.27	1,787,528,524.40
项目	上年度可比期间 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）	3,254,021,157.46	-1,780,924,069.01	1,473,097,088.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	290,378,367.53	290,378,367.53
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）	-129,219,683.35	56,971,389.62	-72,248,293.73
其中：1.基金申购款	122,504,272.77	-55,983,849.81	66,520,422.96
2.基金赎回款	-251,723,956.12	112,955,239.43	-138,768,716.69
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）	3,124,801,474.11	-1,433,574,311.86	1,691,227,162.25

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

华夏领先股票型证券投资基金（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[2015]98 号《关于准予华夏领先股票型证券投资基金注册的批复》的核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏领先股票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 5 月 11 日至 2015 年 5 月 13 日期间共募集 5,017,977,648.86 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 0634 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏领先股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,018,238,445.95 份基金份额，其中认购资金利息折合 260,797.09 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏领先股票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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券、可转换债券）、货币市场工具、权证、资产支持证券、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”)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<年度报告和中期报告>》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本报告期末的财务状况以及本报告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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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) 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。
- (8) 对基金在境内取得的股票的股息、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。基金在境内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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

（9）基金在境内卖出股票按 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

（10）基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

（11）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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	103,865,011.96
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	103,865,011.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,244,125,241.64	1,550,319,962.00	306,194,720.36

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	608,000.00	622,136.00
	银行间市场	-	-
	合计	608,000.00	622,136.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,244,733,241.64	1,550,942,098.00	306,208,856.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	90,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	90,000,000.00	-

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	12,091.09
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	23,786.98
应收债券利息	202.56
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	20,018.24
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	156.50
合计	56,255.37

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,850,954.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,850,954.04

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,179.25
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,481.66
合计	96,660.91

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,852,504,114.61	2,852,504,114.61
本期申购	113,229,284.10	113,229,284.10
本期赎回（以“-”号填列）	-533,185,943.04	-533,185,943.04
本期末	2,432,547,455.67	2,432,547,455.67

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,240,451,634.34	116,450,956.37	-1,124,000,677.97
本期利润	185,783,182.58	145,210,338.02	330,993,520.60
本期基金份额交易产生的变动数	165,557,939.93	-17,569,713.83	147,988,226.10
其中：基金申购款	-44,876,053.55	4,023,861.18	-40,852,192.37
基金赎回款	210,433,993.48	-21,593,575.01	188,840,418.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-889,110,511.83	244,091,580.56	-645,018,931.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	201,626.89
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	215,470.70
其他	2,364.95
合计	419,462.54

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,287,958,727.55
减：卖出股票成本总额	2,094,597,689.16
买卖股票差价收入	193,361,038.39

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	70,854,192.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	68,101,700.00
减：应收利息总额	2,568,364.40
买卖债券差价收入	184,128.40

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股指期货投资收益	4,825,126.22
合计	4,825,126.22

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,153,313.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,153,313.81

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	145,210,338.02
——股票投资	145,369,381.32
——债券投资	-159,043.30
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	145,210,338.02

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	187,491.39
合计	187,491.39

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	5,880,246.87
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	5,880,246.87

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	6,727.00
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	119,808.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	2,401,186,854.36	56.86%	418,863,414.14	22.12%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	215,862.93	9.44%	404,022.50	62.83%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	2,868,100,000.00	79.05%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

	佣金	总量的比例		总额的比例
中信证券	1,756,080.15	55.76%	1,756,080.15	61.60%
关联方名称	上年度可比期间 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	306,313.68	23.85%	268,958.86	3.56%

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。

6.4.10.2 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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,614,319.12	12,531,613.04
其中：支付销售机构的客户维护费	4,250,763.38	4,203,294.35

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 1.50%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×1.50%/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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,102,386.59	2,088,602.10

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 0.25%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×0.25%/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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	103,865,011.96	201,626.89	62,835,054.04	319,884.66

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

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（2020 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	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

				型						
002230	科大讯飞	2019-07-17	2020-07-20	非公开发 行流通 受限	27.10	36.88	97,786	2,650,000.60	3,606,347.68	-
002230	科大讯飞	2019-07-17	2021-07-19	非公开发 行流通 受限	27.10	33.97	97,786	2,650,000.60	3,321,790.42	-
603866	桃李面包	2020-05-25	2020-11-25	非公开发 行流通 受限	43.52	47.87	140,000	6,092,800.00	6,701,800.00	-
688106	金宏气体	2020-06-09	2020-12-16	新发流 通受限	15.48	41.36	26,075	403,641.00	1,078,462.00	-
688298	东方生物	2020-01-20	2020-08-05	新发流 通受限	21.25	144.17	5,286	112,327.50	762,082.62	-
688086	紫晶存	2020-02-19	2020-08-26	新发流	21.49	64.54	9,361	201,167.89	604,158.94	-

	储			通 受 限						
688222	成都 先导	2020-04-03	2020-10-16	新发 流通 受限	20.52	43.70	9,201	188,804.52	402,083.70	-
688157	松井 股份	2020-05-29	2020-12-09	新发 流通 受限	34.48	86.64	3,402	117,300.96	294,749.28	-
688568	中科 星图	2020-06-30	2020-07-08	新发 流通 受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威 尔	2020-06-29	2020-07-08	新发 流通 受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智 航	2020-06-24	2020-07-07	新发 流通 受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾 量子	2020-06-30	2020-07-09	新发 流通 受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川 物联	2020-06-19	2020-07-01	新发 流通 受	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-

				限						
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新发流通受限	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新发流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新发流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新发流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113587	泛微转债	2020-06-15	2020-07-14	新发流通受限	100.00	100.00	4,940	494,000.00	494,000.00	-

注：①以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

②基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施

细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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之内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。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。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	103,865,011.96	-	-	103,865,011.96
结算备付金	45,439,494.87	-	-	45,439,494.87

结算保证金	347,657.58	-	-	347,657.58
债券投资	622,136.00	-	-	622,136.00
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	90,000,000.00	-	-	90,000,000.00
应收直销申购款	-	-	-	-
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	137,113,593.71	-	-	137,113,593.71
结算备付金	1,077,575.67	-	-	1,077,575.67
结算保证金	176,511.31	-	-	176,511.31
债券投资	66,890,879.30	-	-	66,890,879.30
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	48,950,193.43	-	-	48,950,193.43
应收直销申购款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	-	49,584.94
	利率上升 25 个基点	-	-49,506.13

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。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产	公允价值	占基金资产

		净值比例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,550,319,962.00	86.73	1,552,633,498.24	89.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	622,136.00	0.03	508,079.30	0.03
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	1,550,942,098.00	86.76	1,553,141,577.54	89.85

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	+5%	92,712,757.31	84,287,685.14
	-5%	-92,712,757.31	-84,287,685.14

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（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。

（2）各层次金融工具公允价值

截至 2020 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 1,534,170,623.36 元，第二层次的余额为 16,771,474.64 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2019 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 1,538,828,074.69 元，第二层次的余额为 80,696,302.85 元，第三层次的余额为 0 元。）

(3) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)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。

(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	1,550,319,962.00	84.45
	其中:股票	1,550,319,962.00	84.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	622,136.00	0.03
	其中:债券	622,136.00	0.03
	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	90,000,000.00	4.90
	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	149,304,506.83	8.13
8	其他各项资产	45,637,145.05	2.49
9	合计	1,835,883,749.88	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

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	26,833,851.40	1.50

C	制造业	1,023,318,772.68	57.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	76,865,912.00	4.30
G	交通运输、仓储和邮政业	15,043,600.00	0.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,275,966.50	12.99
J	金融业	60,107,403.80	3.36
K	房地产业	42,954,972.00	2.40
L	租赁和商务服务业	37,258,944.00	2.08
M	科学研究和技术服务业	402,083.70	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	8,212,270.00	0.46
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	27,033,419.60	1.51
S	综合	-	-
	合计	1,550,319,962.00	86.73

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600546	山煤国际	6,011,704	70,637,522.00	3.95
2	601100	恒立液压	653,500	52,410,700.00	2.93
3	300750	宁德时代	257,398	44,879,915.28	2.51
4	603659	璞泰来	428,606	44,154,990.12	2.47
5	300724	捷佳伟创	495,500	43,866,615.00	2.45
6	002475	立讯精密	805,104	41,342,090.40	2.31
7	002410	广联达	589,800	41,109,060.00	2.30
8	688169	石头科技	99,538	37,515,872.20	2.10
9	002384	东山精密	1,157,206	34,658,319.70	1.94
10	600570	恒生电子	282,620	30,438,174.00	1.70
11	601128	常熟银行	4,022,100	30,205,971.00	1.69
12	600438	通威股份	1,733,100	30,121,278.00	1.69
13	601688	华泰证券	1,590,450	29,900,460.00	1.67
14	603444	吉比特	54,374	29,851,869.74	1.67
15	002511	中顺洁柔	1,292,000	28,811,600.00	1.61
16	600486	扬农化工	349,068	28,798,110.00	1.61
17	300661	圣邦股份	89,000	27,149,450.00	1.52
18	603916	苏博特	1,075,800	27,056,370.00	1.51
19	300413	芒果超媒	414,623	27,033,419.60	1.51
20	300662	科锐国际	588,600	26,192,700.00	1.47

21	603039	泛微网络	331,847	25,638,499.22	1.43
22	300454	深信服	119,148	24,539,722.08	1.37
23	603801	志邦家居	916,800	24,469,392.00	1.37
24	002371	北方华创	141,394	24,165,648.54	1.35
25	000063	中兴通讯	585,700	23,504,141.00	1.31
26	002555	三七互娱	493,400	23,091,120.00	1.29
27	300782	卓胜微	55,260	22,422,850.20	1.25
28	002460	赣锋锂业	417,211	22,349,993.27	1.25
29	002541	鸿路钢构	761,847	22,276,406.28	1.25
30	600201	生物股份	788,500	21,951,840.00	1.23
31	600988	赤峰黄金	1,836,800	21,857,920.00	1.22
32	300659	中孚信息	353,556	21,220,431.12	1.19
33	002230	科大讯飞	570,872	20,975,617.10	1.17
34	000338	潍柴动力	1,466,532	20,120,819.04	1.13
35	600183	生益科技	679,700	19,894,819.00	1.11
36	000961	中南建设	2,162,500	19,246,250.00	1.08
37	600720	祁连山	1,173,300	19,066,125.00	1.07
38	002179	中航光电	447,344	18,345,577.44	1.03
39	600966	博汇纸业	1,736,300	17,623,445.00	0.99
40	300285	国瓷材料	517,900	17,354,829.00	0.97
41	000858	五 粮 液	101,298	17,334,113.76	0.97
42	601877	正泰电器	656,240	17,291,924.00	0.97
43	000625	长安汽车	1,550,811	17,058,921.00	0.95
44	002250	联化科技	761,000	16,589,800.00	0.93
45	002202	金风科技	1,614,914	16,100,692.58	0.90
46	300791	仙乐健康	191,550	15,312,507.00	0.86
47	300253	卫宁健康	663,650	15,224,131.00	0.85
48	000921	海信家电	1,121,595	13,638,595.20	0.76
49	002001	新 和 成	396,900	11,549,790.00	0.65
50	002271	东方雨虹	281,700	11,445,471.00	0.64
51	600138	中青旅	1,121,200	11,066,244.00	0.62
52	601872	招商轮船	1,850,500	10,788,415.00	0.60
53	600309	万华化学	211,900	10,592,881.00	0.59
54	002891	中宠股份	256,100	10,469,368.00	0.59
55	002311	海大集团	214,900	10,227,091.00	0.57
56	300529	健帆生物	139,460	9,692,470.00	0.54
57	002821	凯莱英	39,585	9,619,155.00	0.54
58	300760	迈瑞医疗	29,606	9,050,554.20	0.51
59	603027	千禾味业	282,380	8,917,560.40	0.50
60	000661	长春高新	20,400	8,880,120.00	0.50
61	300596	利安隆	249,400	8,686,602.00	0.49
62	000656	金科股份	1,053,200	8,594,112.00	0.48
63	300573	兴齐眼药	58,600	8,497,000.00	0.48

64	000513	丽珠集团	171,706	8,243,605.06	0.46
65	603136	天目湖	339,350	8,212,270.00	0.46
66	601966	玲珑轮胎	394,900	7,976,980.00	0.45
67	002810	山东赫达	234,368	7,912,263.68	0.44
68	600383	金地集团	575,000	7,877,500.00	0.44
69	300142	沃森生物	150,122	7,860,387.92	0.44
70	002507	涪陵榨菜	215,800	7,770,958.00	0.43
71	603866	桃李面包	160,707	7,755,579.23	0.43
72	603456	九洲药业	279,400	7,571,740.00	0.42
73	000671	阳光城	1,141,500	7,237,110.00	0.40
74	002601	龙蟠佰利	387,500	7,168,750.00	0.40
75	300381	溢多利	405,100	6,327,662.00	0.35
76	002399	海普瑞	249,033	6,235,786.32	0.35
77	600998	九州通	334,500	6,228,390.00	0.35
78	601101	昊华能源	1,370,780	4,975,931.40	0.28
79	603056	德邦股份	314,500	4,255,185.00	0.24
80	688106	金宏气体	26,075	1,078,462.00	0.06
81	688298	东方生物	5,286	762,082.62	0.04
82	688086	紫晶存储	9,361	604,158.94	0.03
83	688222	成都先导	9,201	402,083.70	0.02
84	688157	松井股份	3,402	294,749.28	0.02
85	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
86	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
87	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
88	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
89	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
90	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
91	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
92	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
93	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
94	300845	N 捷安	470	8,286.10	0.00
95	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
96	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
97	300747	锐科激光	15	1,632.45	0.00
98	000001	平安银行	76	972.80	0.00
99	002614	奥佳华	85	932.45	0.00
100	300166	东方国信	34	421.94	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	600546	山煤国际	65,603,181.66	3.80
2	603916	苏博特	43,968,260.32	2.54
3	300750	宁德时代	43,934,114.74	2.54
4	300724	捷佳伟创	43,588,927.40	2.52
5	300207	欣旺达	42,611,428.81	2.47
6	000063	中兴通讯	39,315,544.00	2.27
7	603659	璞泰来	37,783,704.24	2.19
8	688169	石头科技	37,256,813.93	2.16
9	002475	立讯精密	36,473,030.03	2.11
10	600110	诺德股份	33,644,881.81	1.95
11	601688	华泰证券	27,506,135.00	1.59
12	002410	广联达	26,823,067.27	1.55
13	600547	山东黄金	26,355,309.60	1.52
14	300454	深信服	25,988,175.44	1.50
15	600183	生益科技	25,869,149.32	1.50
16	603039	泛微网络	25,526,866.28	1.48
17	300661	圣邦股份	25,423,706.13	1.47
18	603801	志邦家居	25,229,913.75	1.46
19	000975	银泰黄金	24,708,957.21	1.43
20	603866	桃李面包	24,602,974.42	1.42

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	300207	欣旺达	46,616,101.36	2.70
2	300451	创业慧康	36,117,354.82	2.09
3	603866	桃李面包	34,828,836.30	2.01
4	603986	兆易创新	33,473,364.97	1.94
5	603589	口子窖	31,953,249.26	1.85
6	600346	恒力石化	31,899,295.20	1.85
7	000961	中南建设	29,828,415.89	1.73
8	002385	大北农	29,505,446.00	1.71
9	600809	山西汾酒	28,212,753.68	1.63
10	600110	诺德股份	27,503,810.13	1.59
11	300724	捷佳伟创	27,452,717.00	1.59
12	600547	山东黄金	25,746,732.64	1.49
13	002777	久远银海	25,323,124.24	1.47
14	300450	先导智能	24,272,441.72	1.40
15	300482	万孚生物	23,595,050.39	1.37
16	603799	华友钴业	23,515,766.31	1.36
17	600546	山煤国际	23,416,542.95	1.35

18	000671	阳光城	22,947,581.90	1.33
19	600529	山东药玻	22,709,794.12	1.31
20	000975	银泰黄金	22,530,727.00	1.30

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,946,914,771.60
卖出股票的收入（成交）总额	2,287,958,727.55

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	622,136.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	622,136.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113587	泛微转债	4,940	494,000.00	0.03
2	110061	川投转债	1,140	128,136.00	0.01
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

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	347,657.58
2	应收证券清算款	44,378,790.75
3	应收股利	-
4	应收利息	56,255.37
5	应收申购款	854,441.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,637,145.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110061	川投转债	128,136.00	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
51,571	47,168.90	1,763,625.12	0.07%	2,430,783,830.55	99.93%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,849,238.87	0.08%

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 15 日）基金份额总额	5,018,238,445.95
本报告期期初基金份额总额	2,852,504,114.61
本报告期基金总申购份额	113,229,284.10

减：本报告期基金总赎回份额	533,185,943.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,432,547,455.67

§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 2020 年 4 月 1 日发布公告，张德根先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关责令改正的行政监管措施，公司已按要求改正并报告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	4	2,401,186,854.36	56.86%	1,756,080.15	55.76%	-
东北证券	1	515,249,051.90	12.20%	376,795.53	11.96%	-
中泰证券	2	358,231,533.74	8.48%	261,973.96	8.32%	-
中国银河证券	4	304,396,640.95	7.21%	283,485.81	9.00%	-
长江证券	1	283,188,031.68	6.71%	207,094.20	6.58%	-

新时代证券	1	183,013,801.17	4.33%	133,838.02	4.25%	-
东方证券	1	127,212,015.84	3.01%	93,030.30	2.95%	-
方正证券	1	50,661,014.12	1.20%	37,048.19	1.18%	-

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，本基金还选择了长城证券、国金证券、国盛证券、华安证券、上海证券、信达证券、兴业证券、粤开证券、招商证券、中金财富证券、中金公司、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，国盛证券、华安证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，国泰君安证券的交易单元为本期剔除的交易单元。

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
中信证券	215,862.93	9.44%	2,868,100,000.00	79.05%
东北证券	300,803.10	13.15%	75,000,000.00	2.07%
中泰证券	93,372.37	4.08%	-	-
中国银河证券	1,469,674.40	64.27%	685,000,000.00	18.88%
长江证券	207,080.00	9.06%	-	-
新时代证券	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-
------	---	---	---	---

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根据国家延长春节假期通知及交易所休市安排等调整旗下基金春节后业务办理日期的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-30
2	华夏基金管理有限公司关于调整华夏领先股票型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-04
3	华夏基金管理有限公司关于旗下公募基金 2019 年年报延缓审计与披露的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-26
4	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-01

§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

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏领先股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏领先股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 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

二〇二〇年八月二十九日