华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:二〇一八年八月二十五日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 8 月 23 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深 300ETF
场内简称	华夏 300
基金主代码	510330
交易代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年 12 月 25 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	4, 605, 549, 828 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年 1 月 16 日

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的跟踪标的指数,实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400- 818- 6666	010- 66105798
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		400- 818- 6666	95588
传真		010- 63136700	010- 66105799
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区复兴门内大街 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	易会满

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(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1, 406, 156.14
本期利润	- 2, 313, 996, 616.86
加权平均基金份额本期利润	- 0.5351
本期加权平均净值利润率	- 12.52%
本期基金份额净值增长率	- 12.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6, 386, 913, 482.12
期末可供分配基金份额利润	1.3868
期末基金资产净值	17, 638, 462, 067.35
期末基金份额净值	3.8298
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	62.08%

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

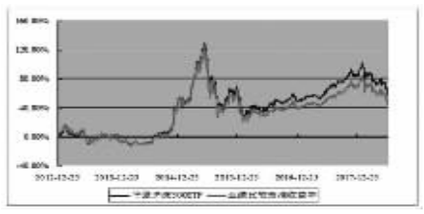
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	- 6.94%	1.29%	- 7.66%	1.28%	0.72%	0.01%
过去三个月	- 9.12%	1.13%	- 9.94%	1.14%	0.82%	- 0.01%
过去六个月	- 12.23%	1.15%	- 12.90%	1.16%	0.67%	- 0.01%
过去一年	- 2.92%	0.95%	- 4.25%	0.95%	1.33%	0.00%
过去三年	- 15.30%	1.49%	- 21.51%	1.49%	6.21%	0.00%
自基金合同生效起至今	62.08%	1.51%	47.44%	1.51%	14.64%	0.00%

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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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

(2012 年 12 月 25 日至 2018 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,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、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中小板 ETF、华夏中证 500ETF、华夏创业板 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、华夏快线货币 ETF 和华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF 等,初步形成了覆盖宽基指数、行业指数、主题指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、A 股市场指数、海外市场指数、信用债指数等较为完整的产品线。

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《中国证券报》评奖活动中,公司荣获"中国基金业 20 周年卓越贡献公司"和"被动投资金牛基金公司"两大奖项,旗下华夏回报混合荣获"2017 年度开放式混合型金牛基金"称号,华夏安康债券荣获"2017 年度开放式债券型金牛基金"称号。在《证券时报》评奖活动中,旗下华夏永福混合和华夏回报混合荣获"三年持续回报绝对收益明星基金"称号,华夏安康债券荣获"三年持续回报积极债券型明星基金"称号,华夏消费升级混合荣获"2017 年度平衡混合型明星基金"称号。在《上海证券报》举行的 2018 中国基金业峰会暨第十五届"金基金"颁奖评选中,华夏基金荣获公募基金 20 周年"金基金"TOP 基金公司大奖、华夏沪深 300ETF 获得第十五届"金基金"指数基金奖(一年期)、华夏上证 50ETF 获得第十五届"金基金"指数基金奖(三年期)。在《证券时报》的评奖活动中,华夏永福混合和华夏回报混合荣获"三年持续回报绝对收益明星基金"称号,华夏安康债券荣获"三年持续回报积极债券型明星基金"称号,华夏消费升级混合荣获"2017 年度平衡混合型明星基金"称号。

在客户服务方面,2018 年上半年,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户使用的便利性和服务体验:(1)华夏基金电子交易平台开展华夏财富宝货币 A、华夏薪金宝货币转换业务优惠活动,为客户提供了更便捷和优惠的基金投资方式;(2)微信服务号上线随存随取业务实时通知功能,方便客户及时了解交易变动的情况;华夏基金网上交易平台上线手机号码登录功能,为客户登录网上交易平台提供了更便捷的方式;(3)与中原银行、长城华西银行、西安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"四大明星基金有奖寻人"、"华夏基金 20 周年司庆感恩二十年"、"华夏基金 20 周年献礼,华夏基金户口本"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		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2012- 12- 25	-	18年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理,上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、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(2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 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(2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间)等。
赵宗庭	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2017- 04- 17	-	10年	对外经济贸易大学经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员,嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理。嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本基金出现 2 次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,为本基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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,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。

上半年,国际方面,美国经济仍较为强劲,通胀率略有上升,失业率维持低位;欧元区制造业 PMI 持续走低,6 月降至今年来最低水平;日本经济继续温和复苏,经济形势相对稳定,但通胀水平依然较低;新兴市场经济体总体经济增长较快,但内部表现继续分化,部分经济体仍旧面临调整与转型压力。国内方面,供给侧结构性改革深入推进,实现了投资继续保持增长、投资结构不断改善的运行态势;消费品市场规模进一步扩大、商品结构持续优化,新兴业态和新商业模式快速发展,消费继续发挥经济增长第一驱动力的作用;出口增速总体保持稳定,进口超预期增长;整体而言,中国经济延续了总体平稳、稳中向好的发展态势。

市场方面,沪深 300 指数在报告期内总体呈现震荡下行的走势,年初因 2017 年经济数据超预期,指数快速上行,并在 1 月末触及上半年最高点;2 月,全球资本市场发生大幅调整,恐慌情绪蔓延至国内,指数开始迅速回落;3 月底以来,中美贸易摩擦持续发酵、资管新规落地、部分上市公司年报业绩爆雷、美联储加息节奏加快、地缘政治变局等诸多因素,令市场避险情绪再度升温,沪深 300 指数震荡下探;6 月底,沪深 300 指数市盈率为 11.9 倍,估值水平接近 2016 年年初低位。

报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对投资者日常申购、赎回以及成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行,经上海证券交易所同意,部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前,本基金的流动性服务商为中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、招商证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、东方证券股份有限公司等。

目前该基金已被调入融资融券标的证券名单。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 3.8298 元,本报告期份额净值增长率为 -12.23%,同期沪深 300 指数增长率为 -12.90%。本基金本报告期跟踪偏离度为 +0.67%,与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国际方面,贸易战和国际金融环境变化的影响仍不确定,但预计美国经济增长仍较为乐观,美联储仍将加息,缩表进程或将加快;欧洲央行货币政策仍将保持耐心、持续和谨慎,意大利经济情况不容乐观,债务危机存在一定风险但目前看还较为可控。国内方面,地产投资、基建投资大概率维持回落态势,制造业将保持温和复苏,同时结构性分化将加大,高端制造业投资或将提速;在扩大内需政策的带动下,下半年或将释放一定内需空间,消费增长逐步得到修复;受制于中美贸易不确定性及我国提出扩大进口促进对外贸易平衡发展的意见,预计下半年净出口对经济增长负面影响将加大。

市场方面,A 股整体估值水平已接近历史低位,具有较高的安全边际,而且绩优股的业绩确定性仍将在长期内产生显著的溢价,沪深 300 等龙头指数仍将为市场所青睐。

本基金将会根据基金合同要求,在紧密跟踪标的指数的基础上,做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司"为信任奉献回报"的经营理念,规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人为准确、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:每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1%以上时,可进行收益分配。基金收益分配采用现金方式。在符合基金收益分配条件的情况下,本基金收益每年最多分配 4 次,每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对华夏沪深 300 交易型开放式指数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,华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、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。

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

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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 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 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
资产:		-	-
银行存款		31, 619, 059.57	18, 009, 104.33
结算备付金		78, 374, 547.99	157, 518, 878.18
存出保证金		51, 350, 993.02	42, 201, 974.48
交易性金融资产		17, 220, 733, 920.51	18, 411, 742, 931.07
其中:股票投资		17, 220, 733, 920.51	18, 402, 578, 531.07
基金投资		-	-
债券投资		-	9, 164, 400.00
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		280, 000, 000.00	80, 000, 000.00
应收证券清算款		95, 665.91	4, 402, 972.69
应收利息		173, 931.73	126, 568.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		17, 662, 348, 118.73	18, 714, 002, 429.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
负债:		-	-
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		9, 340, 012.43	4, 307, 720.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7, 290, 730.08	7, 928, 154.27
应付托管费		1, 458, 146.02	1, 585, 630.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		937, 250.55	626, 392.65
应交税费		25.21	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		4, 859, 887.09	1, 521, 729.42
负债合计		23, 886, 051.38	15, 969, 627.59
所有者权益:		-	-
实收基金		11, 251, 548, 585.23	10, 468, 798, 142.60
未分配利润		6, 386, 913, 482.12	8, 229, 234, 659.45
所有者权益合计		17, 638, 462, 067.35	18, 698, 032, 802.05
负债和所有者权益总计		17, 662, 348, 118.73	18, 714, 002, 429.64

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,基金份额净值 3.82981 元,基金份额总额 4, 605,549,828 份。

6.2 利润表

会计主体:华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年 1 月 1 日至 2018年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		- 2, 254, 079, 019.73	1, 917, 813, 225.67
1.利息收入		3, 042, 606.74	7, 574, 851.73
其中:存款利息收入		1, 344, 903.74	6, 721, 512.24
债券利息收入		10, 687.84	17, 783.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1, 687, 015.16	835, 556.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		58, 356, 852.57	157, 602, 565.27
其中:股票投资收益		- 118, 710, 608.93	- 57, 115, 538.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1, 843, 035.72	565, 728.67
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		1, 015, 983.99	78, 454, 443.16
股利收益		174, 208, 441.79	135, 697, 931.98
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		- 2, 315, 402, 773.00	1, 751, 914, 298.98
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		- 75, 706.04	721, 509.69
减:二、费用		59, 917, 597.13	53, 663, 607.83
1.管理人报酬		45, 760, 405.46	40, 908, 531.91
2.托管费		9, 152, 081.09	8, 181, 706.33
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		2, 108, 247.39	1, 998, 524.57
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		30, 725.93	-
7.其他费用		2, 866, 137.26	2, 574, 845.02
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		- 2, 313, 996, 616.86	1, 864, 149, 617.84
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		- 2, 313, 996, 616.86	1, 864, 149, 617.84

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 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)	10, 468, 798, 142.60	8, 229, 234, 659.45	18, 698, 032, 802.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	- 2, 313, 996, 616.86	- 2, 313, 996, 616.86
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)	782, 750, 442.63	471, 675, 439.53	1, 254, 425, 882.16
其中:1.基金申购款	1, 029, 009, 008.82	679, 204, 413.70	1, 708, 213, 422.52
2.基金赎回款	- 246, 258, 566.19	- 207, 528, 974.17	- 453, 787, 540.36
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)	11, 251, 548, 585.23	6, 386, 913, 482.12	17, 638, 462, 067.35
项目	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	11, 181, 188, 994.97	4, 963, 727, 153.90	16, 144, 916, 148.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1, 864, 149, 617.84	1, 864, 149, 617.84
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)	- 527, 696, 927.65	- 277, 842, 817.53	- 805, 539, 745.18
其中:1.基金申购款	19, 788, 634.80	9, 854, 256.77	29, 642, 891.57
2.基金赎回款	- 547, 485, 562.45	- 287, 697, 074.30	- 835, 182, 636.75
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)	10, 653, 492, 067.32	6, 550, 033, 954.21	17, 203, 526, 021.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4,财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国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
中信期货有限公司("中信期货")	基金管理人股东控股的公司
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金("华夏沪深 300ETF 联接")	该基金是本基金的联接基金

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

无。

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 债券交易

无。

6.4.4.1.4 债券回购交易

无。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	45, 760, 405.46	40, 908, 531.91

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9, 152, 081.09	8, 181, 706.33

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 0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值× 0.1%/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

无。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券	1, 689, 733.00	0.04%	4, 936, 560.00	0.12%
华夏沪深 300ETF 联接	2, 624, 465, 422.00	56.98%	2, 420, 278, 422.00	56.48%

注:除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 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	31, 619, 059.57	212, 507.57	230, 349, 200.29	1, 433, 255.48

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

金额单位:人民币元

本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中信证券	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中信证券	113011	光大转债	老股东优先配售	189, 130	18, 913, 000.00

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 1,974,396,120.00 元(上年度可比期间:133,273,980.00 元),支付给中信期货的佣金为 65,159.97 元(上年度可比期间:3,265.17 元)。

6.4.5 期末(2018 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
603693	江苏新能	2018- 06- 25	2018- 07- 03	新发流通受限	9.00	9.00	5, 384	48, 456.00	48, 456.00	-
603105	芯能科技	2018- 06- 29	2018- 07- 09	新发流通受限	4.83	4.83	3, 410	16, 470.30	16, 470.30	-

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
600221	海航控股	2018- 01- 10	重大事项	3.23	2018- 07- 20	2.91	18, 554, 700	62, 508, 739.13	59, 931, 681.00	-
600485	信威集团	2016- 12- 26	重大事项	14.59	-	-	2, 180, 969	54, 260, 814.08	31, 820, 337.71	-
601118	海南橡胶	2018- 05- 24	重大事项	6.62	-	-	2, 021, 126	13, 363, 699.53	13, 379, 854.12	-
601390	中国中铁	2018- 05- 07	重大事项	7.47	2018- 08- 20	7.25	9, 257, 826	87, 208, 788.92	69, 155, 960.22	-
601727	上海电气	2018- 06- 06	重大事项	6.34	2018- 08- 07	5.71	5, 533, 416	58, 279, 442.25	35, 081, 857.44	-
000008	神州高铁	2018- 06- 06	重大事项	4.96	2018- 08- 07	4.48	1, 709, 530	14, 453, 741.08	8, 479, 268.80	-
000415	渤海金控	2018- 01- 17	重大事项	5.84	2018- 07- 17	5.26	2, 906, 400	24, 696, 082.93	16, 973, 376.00	-
000540	中天金融	2017- 08- 21	重大事项	4.87	-	-	6, 740, 025	39, 044, 036.72	32, 823, 921.75	-
000723	美锦能源	2018- 03- 27	重大事项	5.43	2018- 07- 31	4.89	1, 937, 400	14, 147, 262.41	10, 520, 082.00	-
002252	上海莱士	2018- 02- 23	重大事项	19.52	-	-	2, 366, 502	41, 440, 053.17	46, 194, 119.04	-
002310	东方园林