华夏沪深300指数增强型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十五日

§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。

基金托管人中国农业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	344,580,523.01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	253,264,373.87份	91,316,149.14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	贺倩
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.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

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)	
	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	673,906.40	-494,850.94
本期利润	-34,213,979.05	-11,865,028.09
加权平均基金份额本期利润	-0.1432	-0.1458
本期加权平均净值利润率	-10.19%	-10.55%
本期基金份额净值增长率	-9.87%	-10.01%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018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	70,714,538.26	23,520,789.05
期末可供分配基金份额利润	0.2792	0.2576
期末基金资产净值	323,978,912.13	114,836,938.19
期末基金份额净值	1.279	1.258
3.1.3累计期末指标	报告期末(2018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	27.90%	25.80%

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	-5.61%	1.16%	-7.16%	1.22%	1.55%	-0.06%
过去三个月	-8.12%	1.06%	-9.07%	1.08%	0.95%	-0.02%
过去六个月	-9.87%	1.09%	-11.51%	1.10%	1.64%	-0.01%
过去一年	-2.07%	0.88%	-2.54%	0.90%	0.47%	-0.02%
过去三年	-5.47%	1.48%	-15.93%	1.41%	10.46%	0.07%
自基金合同生效起至今	27.90%	1.57%	9.77%	1.51%	18.13%	0.06%

华夏沪深300指数增强C

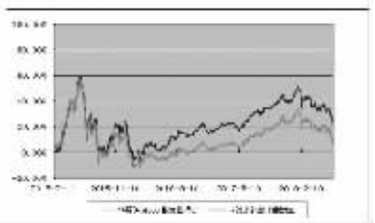
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.63%	1.18%	-7.16%	1.22%	1.53%	-0.04%
过去三个月	-8.24%	1.07%	-9.07%	1.08%	0.83%	-0.01%
过去六个月	-10.01%	1.09%	-11.51%	1.10%	1.50%	-0.01%
过去一年	-2.56%	0.88%	-2.54%	0.90%	-0.02%	-0.02%
过去三年	-6.81%	1.48%	-15.93%	1.41%	9.12%	0.07%
自基金合同生效起至今	25.80%	1.57%	9.77%	1.51%	16.03%	0.06%

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2018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,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		
宋洋	本基金的基金经理、数量投资部总监	2016-11-18	-	8年	中国科学院数学与系统科学研究院博士,曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任数量投资部研究员等。

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

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

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

上半年,国际方面,美国经济复苏,经济数据持续走高,美联储两次宣布加息25bp,并在6月议息会议上调了GDP的增速预期并下调了失业率预期,整体对经济更加乐观;欧元区经济景气度从年初的高位连续下滑,失业率维持低位;日本经济复苏态势整体转弱,经济景气度维持震荡。国内方面,上半年经济整体维持平稳,但经济下行风险升温:2季度GDP同比增长6.7%,增速较1季度下降0.1个百分点;三大投资中,制造业投资增速逐步回升,基建投资下跌幅度加大,而房地产投资增速仍处在高位,形成对上半年经济的主要支撑;消费端,消费增速迭创新低,其中可选消费增速涨跌互现,而必需消费增速全线回落。

市场方面,年初在配置资金涌入、外围经济向好等因素带动下,A股市场风险偏好明显提升,演绎了一波较长时间的持续上涨行情;2月初由于美国经济数据远超预期,引发市场对美联储超预期加息缩表的担忧,美国股市深度调整并带动全球股市快速深跌,A股市场随美股市场下跌并在短暂反弹后又受贸易战拖累,重回调整。在中美贸易战等事件的持续影响下,市场重回防御状态,整体震荡下行,最终在5月下旬开始出现大幅下跌,食品饮料、医药等防御性行业表现稍好。

基金投资运作方面,报告期内,本基金以多因子量化投资策略为主,在控制基金与标的指数跟踪偏离度的基础上,力争获取更高的超额收益。同时,本基金秉承尽职尽责的态度,应对投资者日常申购、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2018年6月30日,华夏沪深300指数增强A基金份额净值为1.279元,本报告期份额净值增长率为-9.87%;华夏沪深300指数增强C基金份额净值为1.258元,本报告期份额净值增长率为-10.01%,同期业绩比较基准增长率为-11.51%。本基金本报告期A类份额跟踪偏离度为+1.64%,C类份额跟踪偏离度为+1.50%。

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,美国经济将继续保持强劲,欧元区经济或将边际企稳,中美贸易摩擦、美联储加息缩表、美国中期选举、地缘政治风险等一系列事件依然是需要重点关注的因素。国内方面,经济下行压力加大,一方面,经济出口面临贸易摩擦带来的不确定性,另一方面,结构性去杠杆下,信用明显收缩,银行风险偏好下降,流动性向实体经济传导或受限制。在中美贸易摩擦、信用违约等一系列事件的影响下,如果经济企稳或有超预期的政策举措,沪深300指数将会有较好的投资机会;反之,则可能呈震荡走势。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,以实现投资者获取指数投资收益及超额收益。

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

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金本报告期未进行利润分配,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一华夏基金管理有限公司2018年1月1日至2018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: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		24,569,292.56	26,364,918.38
结算备付金		4,760,333.67	3,529,362.55
存出保证金		4,778,136.67	57,792.03
交易性金融资产		384,116,410.40	416,456,171.25
其中:股票投资		384,116,410.40	416,456,171.25
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		-	-
买入返售金融资产		23,000,000.00	-
应收证券清算款		9,568,689.82	-
应收利息		10,189.58	7,689.97
应收股利		-	-
应收申购款		949,534.71	339,105.06
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		451,752,587.41	446,755,039.24
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		9,409,606.48	-
应付赎回款		1,413,515.08	1,089,332.72
应付管理人报酬		365,067.42	372,688.18
应付托管费		73,013.50	74,537.63
应付销售服务费		47,357.40	46,093.39
应付交易费用		1,516,416.91	986,452.46
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		111,760.30	90,778.14
负债合计		12,936,737.09	2,659,882.52
所有者权益:			
实收基金		344,580,523.01	314,143,930.34
未分配利润		94,235,327.31	129,951,226.38
所有者权益合计		438,815,850.32	444,095,156.72
负债和所有者权益总计		451,752,587.41	446,755,039.24

注:报告截止日2018年6月30日,华夏沪深300指数增强A基金份额净值1.279元,华夏沪深300指数增强C基金份额净值1.258元;华夏沪深300指数增强基金份额总额344,580,523.01份(其中A类253,264,373.87份,C类91,316,149.14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: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		-40,361,941.22	48,907,938.51
1.利息收入		256,503.77	279,247.65
其中:存款利息收入		137,482.34	220,356.15
债券利息收入		53.36	36.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		118,968.07	58,854.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		5,085,018.21	11,601,128.78
其中:股票投资收益		429,513.64	6,792,057.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益		77,864.20	4,258.45
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		109,858.54	1,050,000.00
股利收益		4,467,781.83	3,754,813.23
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-46,258,062.60	36,753,921.73
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		554,599.40	273,640.35
减:二.费用		5,717,065.92	5,361,935.82
1.管理人报酬		2,220,939.40	1,909,469.39
2.托管费		444,187.97	381,893.91
3.销售服务费		278,196.65	265,264.12
4.交易费用		2,606,870.20	2,599,787.29
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		867.30	-
7.其他费用		166,004.40	205,521.11
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-46,079,007.14	43,546,002.69
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		-46,079,007.14	43,546,002.69

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: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)	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
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)	253,828,679.02	42,262,428.82	296,091,107.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43,546,002.69	43,546,002.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	67,023,825.68	11,171,271.47	78,195,097.15
其中:1.基金申购款	147,591,048.27	29,698,470.98	177,289,519.25
2.基金赎回款	-80,567,222.59	-18,527,199.51	-99,094,422.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	320,852,504.70	96,979,702.98	417,832,207.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

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

6.4报表附注

6.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.2差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3关联方关系

6.4.3.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金管理人的股东
中信证券(山东)有限责任公司("中信证券(山东)")	基金管理人股东控股的公司
上海华夏财富投资管理有限公司("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

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	2,220,939.40	1,909,469.39
其中:支付销售机构的客户维护费	399,446.16	316,563.17

注:①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

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

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 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	444,187.97	381,893.91

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

6.4.4.2.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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
华夏基金管理有限公司	-	145,664.29	145,664.29
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
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C	合计
华夏基金管理有限公司	-	136,066.62	136,066.62
中国农业银行	-	40,249.73	40,249.73
中信证券	-	769.83	769.83
中信证券(山东)	-	235.93	235.93
华夏财富	-	96.69	96.69
合计	-	177,418.80	177,418.80

注:①支付基金销售机构的基金销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给基金管理人,再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。②基金销售服务费计算公式为:C类日基金销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.5%/当年天数。

6.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1报告期内基金管理人运用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

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 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
中国农业银行活期存款	24,569,292.56	102,366.23	6,621,169.37	87,418.39

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

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222,124,980.00元(上年度可比期间:133,273,980.00元),支付给中信期货的佣金为7,766.01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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项	5.84	2018-07-17	5.26	1,346,400	7,968,130.35	7,862,976.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项	7.47	2018-08-20	7.25	631,400	4,719,814.26	4,716,558.00	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大事项	12.89	2018-07-09	11.60	4,100	53,540.77	52,849.00	-

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2018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384,116,410.40元,第二层次的余额为0元,第三层次的余额为0元。(截至2017年12月31日止:第一层次的余额为414,337,178.85元,第二层次的余额为2,118,992.40元,第三层次的余额为0元。)

6.4.6.3公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票,本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次,于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票,本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次,于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

6.4.6.4第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§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	384,116,410.40	85.03
	其中:股票	384,116,410.40	85.03
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	23,000,000.00	5.09
	其中:买断式回购的买入返售金融资