恒生交易型开放式指数证券投资基金 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	恒生交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏恒生ETF
场内简称	恒生ETF
基金主代码	159920
交易代码	159920
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年8月9日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,609,559,219份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年10月22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	本基金的业绩比较基准为经人民币汇率调整的恒生指数收益率。
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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	王永民
	联系电话	400-818-6666	010-66594896
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
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1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1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	陈四清

2.4境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-

2.5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	7,786,077.63
本期利润	-138,731,297.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0601
本期加权平均净值利润率	-3.80%
本期基金份额净值增长率	-1.97%
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	589,636,965.49
期末可供分配基金份额利润	0.2260
期末基金资产净值	3,853,128,256.10
期末基金份额净值	1.4765
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	55.31%

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。

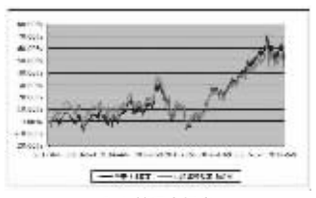
3.2基金净值表现

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	-2.07%	1.21%	-2.00%	1.20%	-0.07%	0.01%
过去三个月	1.57%	1.16%	1.24%	1.15%	0.33%	0.01%
过去六个月	-1.97%	1.24%	-2.39%	1.23%	0.42%	0.01%
过去一年	10.76%	1.04%	9.17%	1.03%	1.59%	0.01%
过去三年	26.56%	1.15%	17.93%	1.15%	8.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	55.31%	1.03%	48.86%	1.06%	6.45%	-0.03%

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

恒生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8月9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		
徐猛	本基金的基金经理、数量投资部总监	2015-12-21	-	15年	清华大学工学硕士,曾任财富证券助理研究员,原中关村证券研究员等。2006年2月加入华夏基金管理有限公司,曾任数量投资部基金经理助理,上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2016年1月29日至2016年3月28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香港恒生指数,恒生指数目前是以香港股市中市值最大及成交最活跃的50家蓝筹股票为成份股样本,以其经调整的流通市值为权数计算得到的加权平均股价指数。该指数自1969年11月24日起正式发布,是香港股市最有影响力的标杆性指数。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,美国经济保持较快增长,就业形势依然强劲,核心CPI指数上行,美联储在3月、6月两次提高联邦基金利率,欧洲央行宣布今年底结束量化宽松。中国经济增速出现温和回落,在经济需求边际弱化、去杠杆政策持续发力、中美贸易摩擦升级的情形下,短期内我国经济增速面临一定的下行压力,社融增速低于预期。货币方面,人民币对美元在1月持续升值,4月则出现持续贬值,汇率波动性增加,央行维持稳健中性的货币政策。政策方面,央行在6月定向降低存款准备金率0.5个百分点。中国香港市场受发达市场和中国内地市场的双重影响,在A股市场大幅波动以及中美贸易摩擦不断反复的背景下,中国香港市场呈现震荡走势。

报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对成份股的定期调整以及投资者日常申购、赎回等工作。

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1.4765元,本报告期份额净值增长率为-1.97%。同期经人民币汇率调整的恒生指数增长率为-2.39%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.42%,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,我们预计美国经济延续上行趋势,美国CPI和核心PCE整体呈现上升趋势,美联储继续加息的概率较大。欧洲央行货币政策正常化进程不断推进,欧洲经济复苏势头放缓。国内方面,房地产行业宏观调控从严,房地产投资增速或将回落,随着中美贸易战继续深化,出口增速也会受到影响,政府或将出台稳增长的政策,在货币政策的边际放松以及财政政策的支持下,我国经济增长的韧性仍然很强。

市场方面,如果主要发达国家的经济保持稳定,国内经济企稳,则目前仍处于历史相对较低估值水平的恒生指数还会有较好的投资机会;反之,则会呈继续震荡的走势。

本基金将根据基金合同要求,在紧密跟踪标的指数的基础上,做好成份股调整及应对申购赎回等工作,并力争和业绩基准保持一致。

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:本基金的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(经汇率调整)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3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(经汇率调整)。法律法规、监管机构、登记结算机构或深圳证券交易所另有规定的从其规定。

本基金本报告期实施利润分配1次,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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在恒生交易型开放式指数证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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:恒生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		347,699,993.63	148,409,427.40
结算备付金		24,410,593.39	81,188,351.04
存出保证金		42,290,492.91	10,525,926.68
交易性金融资产		3,430,399,449.79	2,016,535,377.01
其中:股票投资		3,430,399,449.79	2,016,535,377.01
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		73,623.51	26,787.77
应收股利		18,440,845.36	218,667.56
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,863,314,998.59	2,256,904,537.46
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		5,820,664.13	75,169,664.72
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,003,978.84	1,130,744.16
应付托管费		500,994.73	282,686.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		749,896.23	360,967.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,111,208.56	618,007.89
负债合计		10,186,742.49	77,562,070.74
所有者权益:		-	-
实收基金		2,609,559,219.00	1,375,559,219.00
未分配利润		1,243,569,037.10	803,783,247.72
所有者权益合计		3,853,128,256.10	2,179,342,466.72
负债和所有者权益总计		3,863,314,998.59	2,256,904,537.46

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.4765元,基金份额总额2,609,559,219份。

6.2利润表

会计主体:恒生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		-120,532,744.30	289,136,896.73
1.利息收入		1,668,711.43	361,962.57
其中:存款利息收入		1,668,711.43	361,962.57
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		41,302,862.18	99,662,783.32
其中:股票投资收益		10,042,333.14	53,768,733.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-15,566,948.31	13,767,826.78
股利收益		46,827,477.35	32,126,223.08
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-146,517,375.57	165,783,227.39
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		854,909.68	-1,441,454.45
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-17,841,852.02	4,770,377.90
减:二、费用		18,198,553.64	8,466,693.74
1.管理人报酬		10,883,912.20	5,601,482.54
2.托管费		2,720,978.06	1,400,370.67
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		3,518,078.64	990,041.12
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		42,799.46	-
7.其他费用		1,032,785.28	474,799.41
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-138,731,297.94	260,670,202.99
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-138,731,297.94	260,670,202.99

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:恒生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)	1,375,559,219.00	803,783,247.72	2,179,342,466.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-138,731,297.94	-138,731,297.94
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)	1,234,000,000.00	777,147,587.09	2,011,147,587.09
其中:1.基金申购款	1,468,000,000.00	908,441,667.15	2,376,441,667.15
2.基金赎回款	-234,000,000.00	-131,294,080.06	-365,294,080.06
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)	-	-198,630,499.77	-198,630,499.77
五、期末所有者权益(基金净值)	2,609,559,219.00	1,243,569,037.10	3,853,128,256.10
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)	1,351,559,219.00	292,467,030.36	1,644,026,249.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	260,670,202.99	260,670,202.99
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)	-50,000,000.00	-29,603,916.67	-79,603,916.67
其中:1.基金申购款	284,000,000.00	92,406,123.85	376,406,123.85
2.基金赎回款	-334,000,000.00	-122,010,040.52	-456,010,040.52
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)	1,301,559,219.00	523,533,316.68	1,825,092,535.68

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
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人
中国银行(香港)有限公司("中银香港")	基金境外资产托管人
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金管理人的股东
中信证券经纪(香港)有限公司	基金管理人股东控股的公司
恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金("华夏恒生ETF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

金额单位: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	
	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
中信证券经纪(香港)有限公司	-	-	12,374,804.16	1.84%

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	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
中信证券经纪(香港)有限公司	-	-	-	-
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
中信证券经纪(香港)有限公司	9,899.88	6.61%	-	-

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 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	10,883,912.20	5,601,482.54

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0.6%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× 0.6%/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	2,720,978.06	1,400,370.67

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0.15%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× 0.15%/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	13,575,713.00	0.52%	22,723,427.00	1.65%
华夏恒生ETF联接	533,977,848.00	20.46%	478,874,248.00	34.81%

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
中国银行活期存款	337,784,245.57	1,308,017.07	40,077,178.93	311,467.94
中银香港活期存款	9,915,748.06	-	19,276,102.76	-

注:本基金的活期银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管,按适用利率或约定利率计息。

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。

6.4.5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

无。

6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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3,430,399,449.79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2,016,535,377.01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

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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	3,430,399,449.79	88.79
	其中:普通股	3,430,399,449.79	88.79
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	372,110,587.02	9.63
8	其他各项资产	60,804,961.78	1.57
9	合计	3,863,314,998.59	100.00

注:①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②本基金本报告期末通过沪港通机制投资香港股票的公允价值为2,984,587,176.75元,占基金资产净值比例为77.46%。

7.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	3,430,399,449.79	89.03
合计	3,430,399,449.79	89.03

7.3期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	1,649,164,679.65	42.80
信息技术	425,754,701.07	11.05
房地产	368,255,909.17	9.56
电信业务	188,780,487.96	4.90
能源	228,833,713.78	5.94
公用事业	165,108,403.40	4.29
工业	144,174,549.96	3.74
非必需消费品	133,324,944.51	3.46
必需消费品	85,360,676.81	2.22
材料	-	-
保健	41,641,383.48	1.08
合计	3,430,399,449.79	89.03

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD.	腾讯控股有限公司	00700	香港	中国香港	1,073,203.00	356,317,111.53	9.25
2	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股有限公司	00005	香港	中国香港	5,684,132.00	352,712,668.33	9.15
3	AIA GROUP LTD.	友邦保险控股有限公司	01299	香港	中国香港	5,373,560.00	310,788,762.71	8.07
4	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP.	中国建设银行股份有限公司	00939	香港	中国香港	42,796,465.00	261,592,322.41	6.79
5	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD.	中国工商银行股份有限公司	01398	香港	中国香港	32,831,948.00	162,485,212.16	4.22
6	CHINA MOBILE LTD.	中国移动有限公司	00941	香港	中国香港	2,733,730.00	160,645,101.09	4.17
7	PING AN INSURANCE (GROUP) CO. OF CHINA, LTD.	中国平安保险(集团)股份有限公司	02318	香港	中国香港	2,320,064.00	141,226,518.20	3.67
8	BANK OF CHINA LTD.	中国银行股份有限公司	03988	香港	中国香港	35,353,487.00	115,947,381.82	3.01
9	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD.	香港交易及结算所有限公司	00388	香港	中国香港	524,119.00	104,284,796.02	2.71
10	CNOOC LTD.	中国海洋石油有限公司	00883	香港	中国香港	7,947,385.00	90,723,961.57	2.35

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权益投资明细,应阅读登载于本基金管理人网站的半年度报告正文。

7.5报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD.	00700	226,507,850.62	10.39
2	HSBC HOLDINGS PLC	00005	212,479,037.22	9.75
3	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP.	00939	177,522,805.37	8.15
4	AIA GROUP LTD.	01299	157,137,871.75	7.21
5	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD.	01398	103,587,955.94	4.75
6	CHINA MOBILE LTD.	00941	95,679,192.88	4.39
7	PING AN INSURANCE (GROUP)