华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏沪港通恒生ETF
场内简称	恒生通
基金主代码	513660
交易代码	513660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年12月23日
报告期末基金份额总额	364,000,095份
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经估值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。
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
境外资产托管人英文名称	–
境外资产托管人中文名称	–

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日–2018年9月30日)
1.本期已实现收益	68,926,133.69
2.本期利润	12,561,991.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0278
4.期末基金资产净值	935,246,809.66
5.期末基金份额净值	2.5694

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

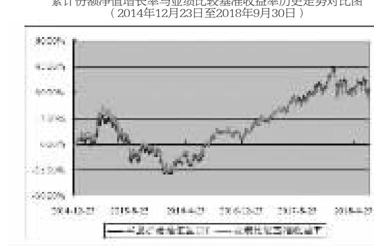
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	0.99%	1.03%	0.17%	1.06%	0.82%	–0.03%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年12月23日至2018年9月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2015–03–12	–	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公平交易专项说明

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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。

3季度,美国经济继续保持快速增长,通货膨胀的压力较大,美联储在9月年内第三次提高联邦基金利率,美元指数维持强势,部分新兴市场国家大幅加息以应对汇率的快速贬值和资本外流。国内经济需求边际弱化,中美贸易摩擦升级,给经济增长带来较大不确定性,为应对经济下行压力,政府积极出台稳增长政策,货币政策适当宽松,引导资金流入实体经济,基建投资加大,积极推动减税政策,货币方面,人民币对美元继续贬值。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升级的背景下,中国香港市场呈现震荡下跌走势。

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、赎回及成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行,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包括广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司等。

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2.5694元,本报告期份额净值增长率为0.99%,同期经估值汇率调整的恒生指数增长率为0.17%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.82%,与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	906,556,334.02	96.52
	其中:普通股	906,556,334.02	96.52
	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	28,518,736.29	3.04
8	其他各项资产	4,163,921.70	0.44
9	合计	939,238,992.01	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906,556,334.02元,占基金资产净值比例为96.93%。

5.2报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	906,556,334.02	96.93
合计	906,556,334.02	96.93

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
金融	444,636,528.44	47.54
通信服务	141,723,916.16	15.15
房地产	85,175,161.29	9.11
能源	67,506,050.62	7.22
公用事业	46,436,696.98	4.97
工业	39,607,031.01	4.23
非必需消费品	36,009,692.28	3.85
必需消费品	21,066,121.80	2.25
信息技术	12,612,464.15	1.35
保健	11,782,671.29	1.26
材料	–	–
合计	906,556,334.02	96.93

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4报告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及存托凭证投资明细

序号	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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	00005	香港	中国香港	1,518,595.00	92,471,106.78	9.89
2	TENCENT HOLDINGS LTD.	腾讯控股	00700	香港	中国香港	308,600.00	87,765,790.62	9.38
3	AIA GROUP LTD.	友邦保险	01299	香港	中国香港	1,415,400.00	87,059,137.98	9.31
4	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP.	建设银行	00939	香港	中国香港	12,285,000.00	73,941,670.53	7.91
5	CHINA MOBILE LTD.	中国移动	00941	香港	中国香港	704,500.00	47,827,196.39	5.11
6	PING AN INSURANCE (GROUP) CO. OF CHINA, LTD.	中国平安	02318	香港	中国香港	635,500.00	44,457,053.89	4.75
7	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD.	工商银行	01398	香港	中国香港	8,485,000.00	42,707,669.29	4.57
8	BANK OF CHINA LTD.	中国银行	03988	香港	中国香港	9,141,000.00	27,991,807.87	2.99
9	CNOOC LTD.	中海油	00883	香港	中国香港	2,038,000.00	27,796,740.55	2.97
10	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD.	港交所	00388	香港	中国香港	136,300.00	26,865,929.44	2.87

注:所用证券代码采用当地市场代码。

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	4,158,270.50
4	应收利息	5,651.20
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,163,921.70

5.10.4报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	532,000,095
报告期基金总申购份额	20,000,000
减:报告期基金总赎回份额	188,000,000
报告期基金拆分变动份额	–
报告期期末基金份额总额	364,000,095

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
华夏沪港通恒生ETF联接	1	2018–07–01至2018–09–30	513,186,849.00	11,965,100.00	182,797,600.00	342,354,349.00	94.05%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平,面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2018年7月5日发布关于华夏基金管理有限公司旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理认购、申购等业务的公告。

2、其他相关信息

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,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股国际通ETF、华夏中小板ETF、华夏中证500ETF、华夏创业板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、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。

在客户服务方面,3季度,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)华夏基金网上交易平台上线闪购业务,为客户提供了更便捷的基金交易方式;(2)对在线智能服务进行全新升级,将机器人小夏全面升级为理财小助手,帮助投资人一搜即达,让投资理财更加便捷、高效;(3)与开源证券、鼎信汇金、北京晟视天下等代销机构合作,为客户提供了更多理财渠道;(4)开展"世界那么大,定投华夏基金再出发"、"揭秘'团长与团员默契度'"等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会准予基金注册的文件;

9.1.2《华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

9.1.4法律意见书;

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2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。

9.3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

二〇一八年十月二十六日

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

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	华夏沪港通恒生ETF联接	
基金主代码	000948	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年1月13日	
报告期末基金份额总额	708,443,158.58份	
投资目标	通过对目标ETF基金份额的投资,追求跟踪标的指数,获得与指数收益相似的回报。	
投资策略	本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况,本基金将综合目标ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标,基金还将投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生工具,如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回以及股指期货之间的套利,以增强基金收益。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为经估值汇率调整的恒生指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。	
风险收益特征	本基金为目标ETF的联接基金,目标ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	华夏沪港通恒生ETF联接A	华夏沪港通恒生ETF联接C
下属分级基金的交易代码	000948	005734
报告期末下属分级基金的份额总额	707,135,138.02份	1,308,020.56份

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	513660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年12月23日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015年1月26日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品概况

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经估值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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日–2018年9月30日)	
	华夏沪港通恒生ETF联接A	华夏沪港通恒生ETF联接C
1.本期已实现收益	82,488,092.57	98,358.41
2.本期利润	12,026,647.86	50,890.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0136	0.0477
4.期末基金资产净值	888,281,111.76	1,641,016.08
5.期末基金份额净值	1.2562	1.2546

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

华夏沪港通恒生ETF联接A:

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.87%	1.04%	0.18%	1.00%	0.69%	0.04%

华夏沪港通恒生ETF联接C:

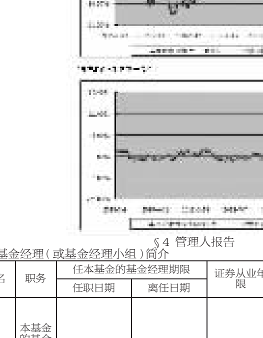
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	0.79%	1.04%	0.18%	1.00%	0.61%	0.04%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年1月13日至2018年9月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2015–03–12	–	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公平交易专项说明

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,业绩比较基准为:经估值汇率调整的恒生指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。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。本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF(华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金),从而实现基金投资目标,基金也可以通过买入恒生指数成份股来跟踪标的指数。

3季度,美国经济继续保持快速增长,通货膨胀的压力较大,美联储在9月年内第三次提高联邦基金利率,美元指数维持强势,部分新兴市场国家大幅加息以应对汇率的快速贬值和资本外流。国内经济需求边际弱化,中美贸易摩擦升级,给经济增长带来较大不确定性,为应对经济下行压力,政府积极出台稳增长政策,货币政策适当宽松,引导资金流入实体经济,基建投资加大,积极推动减税政策,货币方面,人民币对美元继续贬值。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升级的背景下,中国香港市场呈现震荡下跌走势。

报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,华夏沪港通恒生ETF联接A份额净值为1.2562元,本报告期份额净值增长率为0.87%,同期业绩比较基准增长率0.18%,华夏沪港通恒生ETF联接A本报告期跟踪偏离度为+0.69%;华夏沪港通恒生ETF联接C份额净值为1.2546元,本报告期份额净值增长率为0.79%,同期业绩比较基准增长率0.18%,华夏沪港通恒生ETF联接C本报告期跟踪偏离度为+0.61%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,639.56	0.00
	其中:普通股	5,639.56	0.00
	存托凭证	–	–
2	基金投资	879,645,264.32	98.57
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	12,248,136.53	1.37
8	其他各项资产	544,759.80	0.06
9	合计	892,443,800.21	100.00

注: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5,639.56元,占基金资产净值比例为0.00%。

5.2报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	5,639.56	0.00
合计	5,639.56	0.00

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
金融	3,083.34	0.00
房地产	2,556.22	0.00
信息技术	–	–
通信服务	–	–
能源	–	–
公用事业	–	–
工业	–	–
非必需消费品	–	–
必需消费品	–	–
材料	–	–
保健	–	–
合计	–	–

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4报告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及存托凭证投资明细

序号	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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	THE BANK OF EAST ASIA LTD.	东亚银行	00023	香港	中国香港	120.00	3,083.34	0.00
2	NEW WORLD DEVELOPMENT CO. LTD.	新世界	00017	香港	中国香港	272.00	2,556.22	0.00
3	–	–	–	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–	–	–	–
6	–	–	–	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–	–	–	–

注:所用证券代码采用当地市场代码。

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	华夏沪港通恒生ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	879,645,264.32	98.85
2	–	–	–	–	–	–
3	–	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–	–
6	–	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–	–

5.10投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,923.46
2	应收证券清算款	511,280.40
3	应收股利	42.73
4	应收利息	2,152.36
5	应收申购款	360.85
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	544,759.80

5.10.4报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华夏沪港通恒生ETF联接A	华夏沪港通恒生ETF联接C
本报告期期初基金份额总额	1,062,187,718.91	1,140,386.40
报告期基金总申购份额	63,156,174.92	1,364,955.09
减:报告期基金总赎回份额	418,208,755.81	1,197,320.93
报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	707,135,138.02	1,308,020.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018–07–01至2018–07–24	355,487,246.08	–	355,487,246.08	–	–
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平,面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2018年7月5日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为代销机构的公告。

2018年7月5日发布关于华夏基金管理有限公司旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理认购、申购等业务的公告。

2018年7月26日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构的公告。

2018年8月8日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增开源证券股份有限公司为代销机构的公告。

2018年8月9日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海证券有限责任公司开通定期定额申购业务的公告。

2018年8月20日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国国际金融股份有限公司开通定期定额申购业务的公告。

2018年9月12日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构的公告。

2018年9月21日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中民财富基金销售(上海)有限公司为代销机构的公告。

2、其他相关信息

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,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股国际通ETF、华夏中小板ETF、华夏中证500ETF、华夏创业板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、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。

在客户服务方面,3季度,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)华夏基金网上交易平台上线闪购业务,为客户提供了更便捷的基金交易方式;(2)对在线智能服务进行全新升级,将机器人小夏全面升级为理财小助手,帮助投资人一搜即达,让投资理财更加便捷、高效;(3)与开源证券、鼎信汇金、北京晟视天下等代销机构合作,为客户提供了更多理财渠道;(4)开展"世界那么大,定投华夏基金再出发"、"揭秘'团长与团员默契度'"等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会准予基金注册的文件;

9.1.2《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合同》;

9.1.3《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托管协议》;

9.1.4法律意见书;

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2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。

9.3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

二〇一八年十月二十六日

华夏沪深300指数增强型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十六日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	389,030,150.22份	
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。	
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	
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	281,485,074.23份	107,545,075.99份

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日–2018年9月30日)	
	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C
1.本期已实现收益	–14,805,129.94	–5,686,482.01
2.本期利润	–2,537,222.15	–877,600.04
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0095	–0.0087
4.期末基金资产净值	356,071,718.43	133,572,555.54
5.期末基金份额净值	1.265	1.242

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。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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

华夏沪深300指数增强A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	–1.09%	1.31%	–1.57%	1.29%	0.48%	0.02%

华夏沪深300指数增强C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	–1.27%	1.31%	–1.57%	1.29%	0.30%	0.02%

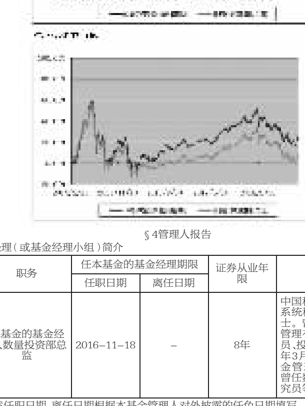
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏沪深300指数增强型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年2月10日至2018年9月30日)

华夏沪深300指数增强A



§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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公平交易专项说明

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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。

3季度,国际方面,全球经济仍处于上行态势,但是复苏趋势有所减缓。美国在税改等积极财政政策推动下,制造业回流与消费繁荣支撑经济增长;欧元区经济疲弱势头有所改善;英国综合PMI较为平稳,日本则有上升趋势。国内方面,经济景气度稳中趋弱,需求总体依旧承压。从三驾马车来看,受中美贸易摩擦影响,贸易端对经济的拉动作用略有弱化;消费端,个税调整对冲下行压力,增速回落总体可控;投资端,制造业投资回升持续性有待观察,积极财政政策有望带动基建投资逐步企稳回升。

市场方面,在中美贸易摩擦和经济下行承压的双重影响之下,投资者情绪整体低落,市场呈现出震荡下行的态势。其中,金融和国防军工板块表现较好,而上半年表现抢眼的医药板块受疫苗事件的影响大幅回调。

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9月30日,华夏沪深300指数增强A基金份额净值为1.265元,本报告期份额净值增长率为–1.09%;华夏沪深300指数增强C基金份额净值为1.242元,本报告期份额净值增长率为–1.27%,同期业绩比较基准增长率为–1.57%。本基金本报告期A类份额跟踪偏离度为+0.48%,C类份额跟踪偏离度为+0.30%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	463,892,861.45	93.98
	其中:股票	463,892,861.45	93.98
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
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	银行存款和结算备付金合计	29,101,405.07	5.90
7	其他资产	601,460.44	0.12
8	合计	493,595,726.96	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1指数投资按行业分类的股票投资组合

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	21,761,383.00	4.44
C	制造业	162,538,454.96	33.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,879,264.00	2.22
E	建筑业	16,886,095.75	3.45
F	批发和零售业	13,634,342.00	2.78
G	交通运输、仓储和邮政业	9,156,698.00	1.87
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,385,481.00	1.30
J	金融业	160,763,173.00	32.83
K	房地产业	20,813,141.00	4.25
L	租赁和商务服务业	9,904,774.00	2.02
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	874,425.00	0.18
S	综合	–	–
	合计	433,597,231.71	88.55

5.2.1.2积极投资按行业分类的股票投资组合

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	–	–
C	制造业	14,265,901.74	2.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,368,825.00	0.69
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	2,004,975.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	290,997.00	0.06
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,840,656.00	1.40
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
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	3,524,275.00	0.72
S	综合	–	–
	合计	30,295,629.74	6.19

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	417,262	28,582,447.00	5.84
2	601166	兴业银行	1,120,700	17,875,165.00	3.65
3	000651	格力电器	426,552	17,147,390.40	3.50
4	600016	民生银行	2,598,280	16,473,095.20	3.36
5	601328	交通银行	2,588,600	15,117,424.00	3.09
6	000858	五粮液	213,700	14,520,915.00	2.97
7	600519	贵州茅台	17,644	12,880,120.00	2.63
8	002415	海康威视	415,700	11,947,218.00	2.44
9	600015	华夏银行	1,297,400	10,599,758.00	2.16
10	600837	海通证券	1,165,400	10,441,984.00	2.13

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600426	华鲁恒升	358,000.00	6,161,180.00	1.26
2	002110	三钢闽光	212,500.00	3,737,875.00	0.76
3	002195	二三四五	810,400.00	3,484,720.00	0.71
4	000539	粤电力A	693,000.00	3,028,410.00	0.62
5	002373	千方科技	260,000.00	2,925,000.00	0.60

5.4报告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。

5.5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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	70,664.89
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	7,416.88
5	应收申购款	523,378.67
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	601,460.44

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6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。

§6开放式基金份额变动

单位:份

项目	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C
报告期期初基金份额总额	253,264,373.87	91,316,149.14
报告期基金总申购份额	47,013,565.95	25,687,993.45
减:报告期基金总赎回份额	18,792,865.59	9,459,066.60
报告期基金拆分变动份额	–	–
报告期期末基金份额总额	281,485,074.23	107,545,075.99

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1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。

8.2影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2018年7月5日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为代销机构的公告。

2018年7月5日发布关于华夏基金管理有限公司旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理认购、申购等业务的公告。

2018年7月26日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构的公告。

2018年8月8日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增开源证券股份有限公司为代销机构的公告。

2018年8月20日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国国际金融股份有限公司开通定期定额申购业务的公告。

2018年8月30日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增广发证券股份有限公司为代销机构的公告。

2018年9月5日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增江苏银行股份有限公司为代销机构的公告。

2、其他相关信息

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,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股国际通ETF、华夏中小板ETF、华夏中证500ETF、华夏创业板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、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。

在客户服务方面,3季度,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)华夏基金网上交易平台上线闪购业务,为客户提供了更便捷的基金交易方式;(2)对在线智能服务进行全新升级,将机器人小夏全面升级为理财小助手,帮助投资人一搜即达,让投资理财更加便捷、高效;(3)与开源证券、鼎信汇金、北京晟视天下等代销机构合作,为客户提供了更多理财渠道;(4)开展"世界那么大,定投华夏基金再出发"、"揭秘'团长与团员默契度'"等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件;

9.1.2《华夏沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》;

9.1.4法律意见书;

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2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。

9.3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

二〇一八年十月二十六日