

中小企业板交易型开放式指数基金

2019年第一季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一九年四月二十日

§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法律责任。  
基金托管人交通银行股份有限公司根据华夏基金合同约定,于2019年4月16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,基金管理人亦不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	华夏中小板ETF
场内简称	中小板
基金代码	159022
交易代码	159022
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2009年6月18日
报告期末基金份额总额	840,152,483.00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	本基金采用完全复制法,即完全按照标的指数的构成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将通过其他合理方法进行替代,以期达到跟踪标的指数的投资目标。 本基金的投资范围包括“中小企业板”指数。 本基金的投资范围包括“中小企业板”指数。 本基金的投资范围包括“中小企业板”指数。
业绩比较基准	中小企业板价格指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险与收益高于货币型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为股票型基金,风险与收益高于货币型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为股票型基金,风险与收益高于货币型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2019年1月1日至2019年3月31日
1.本期净收益	-68,514,712.00
2.本期利润	708,642,263.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.8287
4.期末基金份额净值	2,016,857,688.25
5.期末基金资产净值	1,701,310,100.36

注:上述指标按照扣减基金管理费和基金托管费后的净值计算。  
注:上述指标按照扣减基金管理费和基金托管费后的净值计算。  
注:上述指标按照扣减基金管理费和基金托管费后的净值计算。

净低于五千万元的情形。 §6 投资组合报告

§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	2,600,273,336.88	99.02
2	固定收益投资	2,600,273,336.88	99.02
3	其中:债券	3,762,329.49	0.14
4	其中:股票	3,762,329.49	0.14
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	7,441,123.22	0.28
10	其他各项资产	1,271,448.27	0.05
11	合计	2,612,768,227.87	100.00

注:①上述报告期末,满任日期前本基金管理人对外披露的无固定期限报告。  
注:②报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	52,934,314.03	2.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,639,918,817.13	62.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,042,149.70	1.87
F	批发和零售业	103,626,048.04	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	43,400,953.00	1.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	313,297,956.43	12.00
J	金融业	209,776,467.97	7.75
K	房地产业	27,727,000.00	1.07
L	租赁和商务服务业	92,759,657.40	3.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	8,743,868.20	0.33
O	医药、生物和医疗保健业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	43,126,467.66	1.65
R	文化、体育和娱乐业	21,694,974.41	0.83
S	综合	2,600,273,336.88	99.02

§2 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	002415	海康威视	4,936,772	173,154,949.04	6.63
2	002294	洋河股份	762,007	101,869,323.34	3.71
3	002078	安洁科技	3,271,913	89,416,022.80	3.29
4	002229	科大讯飞	3,222,740	80,862,224.00	2.99
5	002142	宁波银行	3,396,921	72,128,362.04	2.76
6	002027	分众传媒	10,813,148	67,798,437.96	2.49
7	002094	比亚迪	1,185,698	63,422,944.14	2.33
8	003024	苏泊尔	4,956,016	62,116,748.80	2.28
9	002292	金钢钨业	3,298,599	56,266,706.46	2.12
10	002038	华鲁恒升	1,268,074	53,111,825.20	1.94

§3 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债券投资明细

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	002415	海康威视	4,936,772	173,154,949.04	6.63
2	002294	洋河股份	762,007	101,869,323.34	3.71
3	002078	安洁科技	3,271,913	89,416,022.80	3.29
4	002229	科大讯飞	3,222,740	80,862,224.00	2.99
5	002142	宁波银行	3,396,921	72,128,362.04	2.76
6	002027	分众传媒	10,813,148	67,798,437.96	2.49
7	002094	比亚迪	1,185,698	63,422,944.14	2.33
8	003024	苏泊尔	4,956,016	62,116,748.80	2.28
9	002292	金钢钨业	3,298,599	56,266,706.46	2.12
10	002038	华鲁恒升	1,268,074	53,111,825.20	1.94

净低于五千万元的情形。 §6 投资组合报告

§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	3,563,933,217.69	88.17
2	固定收益投资	162,462,038.30	4.02
3	其中:债券	162,462,038.30	4.02
4	其中:股票	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	292,266,212.01	7.20
10	其他各项资产	12,116,412.01	0.30
11	合计	4,039,768,668.29	100.00

注:①上述报告期末,满任日期前本基金管理人对外披露的无固定期限报告。  
注:②报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	124,418,498.16	3.11
C	制造业	896,994,821.46	22.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,699,826.63	3.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	217,360,413.47	5.43
G	交通运输、仓储和邮政业	418,019,488.36	10.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	51,714,520.94	1.29
J	金融业	1,514,079,462.56	37.94
K	房地产业	113,526,218.28	2.94
L	租赁和商务服务业	54,600,868.24	1.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	医药、生物和医疗保健业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	13,662,360.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	28,943,720.00	0.72
S	综合	3,563,933,217.69	88.17

§2 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	4,883,550	577,268,766.00	14.43
2	600036	招商银行	10,750,154	382,149,821.68	9.60
3	601336	新华保险	4,796,768	267,403,260.04	6.44
4	000858	五粮液	1,729,758	164,327,000.00	4.11
5	601901	中国太保	4,662,209	168,261,194.36	3.98
6	002087	周大生	4,084,181	143,232,227.67	3.61
7	601111	中国国旅	12,229,166	132,564,164.44	3.21
8	600029	南方航空	16,173,510	129,733,610.69	3.24
9	000988	华泰证券	9,756,666	124,418,498.16	3.11
10	600116	民生银行	17,612,589	122,228,938.02	3.06

§3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	002415	海康威视	4,936,772	173,154,949.04	6.63
2	002294	洋河股份	762,007	101,869,323.34	3.71
3	002078	安洁科技	3,271,913	89,416,022.80	3.29
4	002229	科大讯飞	3,222,740	80,862,224.00	2.99
5	002142	宁波银行	3,396,921	72,128,362.04	2.76
6	002027	分众传媒	10,813,148	67,798,437.96	2.49
7	002094	比亚迪	1,185,698	63,422,944.14	2.33
8	003024	苏泊尔	4,956,016	62,116,748.80	2.28
9	002292	金钢钨业	3,298,599	56,266,706.46	2.12
10	002038	华鲁恒升	1,268,074	53,111,825.20	1.94

净低于五千万元的情形。 §6 投资组合报告

§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	3,563,933,217.69	88.17
2	固定收益投资	162,462,038.30	4.02
3	其中:债券	162,462,038.30	4.02
4	其中:股票	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	292,266,212.01	7.20
10	其他各项资产	12,116,412.01	0.30
11	合计	4,039,768,668.29	100.00

注:①上述报告期末,满任日期前本基金管理人对外披露的无固定期限报告。  
注:②报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	124,418,498.16	3.11
C	制造业	896,994,821.46	22.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,699,826.63	3.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	217,360,413.47	5.43
G	交通运输、仓储和邮政业	418,019,488.36	10.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	51,714,520.94	1.29
J	金融业	1,514,079,462.56	37.94
K	房地产业	113,526,218.28	2.94
L	租赁和商务服务业	54,600,868.24	1.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	医药、生物和医疗保健业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	13,662,360.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	28,943,720.00	0.72
S	综合	3,563,933,217.69	88.17

§2 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	4,883,550	577,268,766.00	14.43
2	600036	招商银行	10,750,154	382,149,821.68	9.60
3	601336	新华保险	4,796,768	267,403,260.04	6.44
4	000858	五粮液	1,729,758	164,327,000.00	4.11
5	601901	中国太保	4,662,209	168,261,194.36	3.98
6	002087	周大生	4,084,181	143,232,227.67	3.61
7	601111	中国国旅	12,229,166	132,564,164.44	3.21
8	600029	南方航空	16,173,510	129,733,610.69	3.24
9	000988	华泰证券	9,756,666	124,418,498.16	3.11
10	600116	民生银行	17,612,589	122,228,938.02	3.06

§3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	002415	海康威视	4,936,772	173,154,949.04	6.63
2	002294	洋河股份	762,007	101,869,323.34	3.71
3	002078	安洁科技	3,271,913	89,416,022.80	3.29
4	002229	科大讯飞	3,222,740	80,862,224.00	2.99
5	002142	宁波银行	3,396,921	72,128,362.04	2.76
6	002027	分众传媒	10,813,148	67,798,437.96	2.49
7	002094	比亚迪	1,185,698	63,422,944.14	2.33
8	003024	苏泊尔	4,956,016	62,116,748.80	2.28
9	002292	金钢钨业	3,298,599	56,266,706.46	2.12
10	002038	华鲁恒升	1,268,074	53,111,825.20	1.94

净低于五千万元的情形。 §6 投资组合报告

§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	3,563,933,217.69	88.17
2	固定收益投资	162,462,038.30	4.02
3	其中:债券	162,462,038.30	4.02
4	其中:股票	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	292,266,212.01	7.20
10	其他各项资产	12,116,412.01	0.30
11	合计	4,039,768,668.29	100.00

注:①上述报告期末,满任日期前本基金管理人对外披露的无固定期限报告。  
注:②报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	124,418,498.16	3.11
C	制造业	896,994,821.46	22.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,699,826.63	3.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	217,360,413.47	5.43
G	交通运输、仓储和邮政业	418,019,488.36	10.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	51,714,520.94	1.29
J	金融业	1,514,079,462.56	37.94
K	房地产业	113,526,218.28	2.94
L	租赁和商务服务业	54,600,868.24	1.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	医药、生物和医疗保健业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	13,662,360.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	28,943,720.00	0.72
S	综合	3,563,933,217.69	88.17

§2 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	4,883,550	577,268,766.00	14.43
2	600036	招商银行	10,750,154	382,149,821.68	9.60
3	601336	新华保险	4,796,768	267,403,260.04	6.44
4	000858	五粮液	1,729,758	164,327,000.00	4.11
5	601901	中国太保	4,662,209	168,261,194.36	3.98
6	002087	周大生	4,084,181	143,232,227.67	3.61
7	601111	中国国旅	12,229,166	132,564,164.44	3.21
8	600029	南方航空	16,173,510	129,733,610.69	3.24
9	000988	华泰证券	9,756,666	124,418,498.16	3.11
10	600116				