上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金 2019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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十九日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月27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2019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	上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金简称	华夏金融ETF
场内简称	金融行业
基金主代码	510650
交易代码	510650
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年3月28日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,452,472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5月8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,以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等原因导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将酌配使用其他合理方法(如买入非成份股等)进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证金融地产行业指数。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	田青
	联系电话	010-67595096	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区A区	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		杨明辉	田国立

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(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期已实现收益	1,827,688.15
本期利润	8,582,438.33
加权平均基金份额本期利润	0.4329
本期加权平均净值利润率	23.81%
本期基金份额净值增长率	27.45%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	10,887,503.60
期末可供分配基金份额利润	0.5900
期末基金资产净值	36,156,366.10
期末基金份额净值	1.9594
3.1.3累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	95.94%

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。

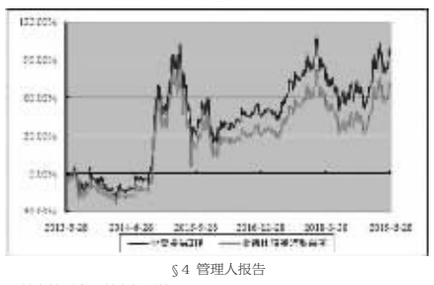
3.2基金净值表现

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	7.52%	1.16%	6.74%	1.14%	0.78%	0.02%
过去三个月	2.99%	1.41%	1.98%	1.41%	1.01%	0.00%
过去六个月	27.45%	1.58%	26.81%	1.59%	0.64%	-0.01%
过去一年	25.51%	1.54%	23.63%	1.55%	1.88%	-0.01%
过去三年	41.11%	1.17%	33.92%	1.18%	7.19%	-0.01%
自基金合同生效起至今	95.94%	1.63%	68.97%	1.66%	26.97%	-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

上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金
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
(2013年3月28日至2019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、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通ETF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MSCI中国A股国际通ETF、华夏恒生ETF、华夏沪港通恒生ETF、华夏野村日经225ETF、华夏中证500ETF、华夏中小板ETF、华夏创业板ETF、华夏中证央企ETF、华夏中证四川国改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、华夏创蓝筹ETF、华夏创成长ETF、华夏快钱货币ETF及华夏3-5年中高级可质押信用债ETF,初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta策略、A股市场指数、海外市场指数及信用债指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告,在基金分类排名中(截至2019年6月30日数据),华夏移动互联混合(QDII)在"QDII基金-QDII混合基金-QDII混合基金(A类)"中排序9/34;华夏稳增混合在"混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金(A类)"中排序8/27;华夏回报混合(H类)在"混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金(非A类)"中排序8/89;华夏鼎沛债券(A类)在"债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级)(A类)"中排序1/228;华夏理财30天债券(A类)在"债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金(摊余成本法)(A类)"中排序10/40;华夏恒融定开债券在"债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金(二级)(A类)"中排序7/19;华夏上证50AH优选指数(LOF)(A类) 在"股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(A类)"中排序8/29;华夏上证50AH优选指数(LOF)(C类)在"标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(非A类)"中排序4/11;华夏上证50ETF在"股票基金-股票ETF基金-规模指数股票ETF基金"中排序6/61;华夏消费ETF在"股票基金-股票ETF基金-行业指数股票ETF基金"中排序3/31;华夏沪深300ETF联接(C类)在"股票基金-股票ETF联接基金-规模指数股票ETF联接基金(非A类)"中排序9/34。

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。在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上,华夏安康债券、华夏收益债券(QDII)和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报QDII明星基金和2018年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中,华夏基金荣获"被动投资金牛基金公司"奖,华夏鼎茂债券(004042)荣获"2018年度开放式债券型金牛基金"奖,华夏中小板ETF(159902)荣获"2018年度开放式指数型金牛基金"奖。

在客户服务方面,2019年上半年度,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)华夏基金客服电话系统上线智能语音功能,客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金信息,同时系统还可以进行身份信息认证,主动告知业务办理进度,为客户提供全面、准确、便捷的服务,提升客户体验;(2)直销电子交易平台开通华夏惠利货币A的快速赎回业务,为广大投资者的资金使用提供便利;(3)与微众银行、华融湘江银行、紫金农商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"你的今年收益知否?知否?"、"你的户口本更新了"、"户龄"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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
徐猛	本基金的基金经理、数量投资部总监	2013-4-8	-	16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。
李俊	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2017-12-11	-	11年	北京大学法学学士、工商管理硕士。曾任职于北京市金杜律师事务所证券部。2008年12月加入华夏基金管理有限公司,曾任数量投资部研究员、基金经理助理等。

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》等法律法规和基金合同,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上证金融地产行业指数,是上证行业指数系列的组成部分。上证行业指数选择上海证券市场各行业中规模大、流动性好的股票组成样本股,自2009年1月9日起正式发布,以反映上海证券市场不同行业公司股票的整体表现。本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

上半年,国际方面,全球经济增长乏力,美国方面,经济整体较好,但也逐渐显露疲态,美联储暗示了未来降息的可能性;欧洲方面,经济增长持续低迷,央行政策维持鸽派。国内方面,经济运行整体保持在合理区间,1季度经济弱势企稳,GDP同比增长6.4%,但2季度明显回落,GDP同比增长6.2%。从政策因素看,财政政策较为积极,货币政策整体维持宽松。与此同时,政府在稳经济、稳就业的同时,也保持了改革的战略定力。通胀方面,受鲜果、猪肉等价格因素影响,CPI维持高位。

市场方面,年初受经济弱势企稳、货币政策宽松、中美贸易谈判重启、外资流入、减税降费等积极因素影响,投资者风险偏好明显提升,A股经历了一波较大幅度的、持续的上涨;但随着2季度中美贸易摩擦再起、经济数据回落、包商银行接管事项引发市场对中小银行、非银机构担忧等事项影响,市场经历了一波较大幅度的调整,之后,随着G20会议后中美恢复谈判、美联储释放降息信号以及监管层在包商银行监管一事引发市场波动后及时出手,稳定了市场,市场情绪逐渐好转。

基金投资运作方面,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中信证券股份有限公司、中国银河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2019年6月30日,本基金份额净值为1.9594元,本报告期份额净值增长率为27.45%,同期上证金融地产行业指数增长率为26.81%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.64%,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,受贸易战等因素影响,全球经济增长料将延续回落态势,全球货币政策走向、美国大选筹备期间的对华策略、贸易战的未来演变、贸易规则的重塑、利益格局的调整……都加大了世界经济与金融市场的不确定性,也是我们关注的重点。国内方面,贸易战带来的心理上的最大冲击波或已过去,但对经济本身的影响仍在渐次呈现、其对未来世界分工结构与贸易体系的持续影响仍需不断评估。中美贸易战从横眉冷对、剑拔弩张到继续坐下谈判,其背后与其说是有共同的利益,不如说是因为各自都有亟待解决的问题,双方只是在理想与现实间各自选择妥协,以空间换时间,因此反复在所难免,其背后的战略对抗更难言消弭,面对今日之局势,一方面政策环境料将维持平稳,将更加关注市场之关切;另一方面,时不我待,如果我们痛定思痛,以此为契机加大改革力度,重塑市场在资源配置中的决定性作用,持续强化对经济质量的追求,未来不排除出现另一番全新的局面。如果经济能够维持稳定或政府出台超预期的改革或提振市场的政策,代表低估值金融蓝筹股的上证金融地产行业指数或有相对较好的表现。

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其他模式盈利的投资目标。同时,我们也将积极争取推动产品的进一步创新,充分发挥ETF的功能,为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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,本基金收益分配应遵循下列原则: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2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、监管机构、登记结算机构、上海证券交易所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

本基金自2019年1月1日至2019年6月30日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已向中国证监会进行报告并提出解决方案。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		-	-
银行存款		751,186.82	532,430.64
结算备付金		388,948.77	218,293.44
存出保证金		87,680.87	71,075.38
交易性金融资产		35,038,842.13	29,925,897.43
其中:股票投资		35,038,842.13	29,925,897.43
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		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		365.13	258.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		36,267,023.72	30,747,955.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,664.79	13,757.15
应付托管费		2,932.95	2,751.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,603.75	5,655.35
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		86,456.13	50,000.00
负债合计		110,657.62	72,163.94
所有者权益:		-	-
实收基金		18,452,472.00	19,952,472.00
未分配利润		17,703,894.10	10,723,319.09
所有者权益合计		36,156,366.10	30,675,791.09
负债和所有者权益总计		36,267,023.72	30,747,955.03

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.9594元,基金份额总额18,452,472份。

6.2利润表

会计主体:上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		8,791,659.39	-5,741,104.04
1.利息收入		5,622.93	6,132.76
其中:存款利息收入		5,622.93	6,132.76
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)		2,034,967.26	1,701,468.32
其中:股票投资收益		1,460,999.73	1,434,195.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		153,697.28	-116,207.18
股利收益		420,270.25	383,479.88
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		6,754,750.18	-7,443,020.32
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-3,680.98	-5,684.80
减:二、费用		209,221.06	244,806.36
1.管理人报酬		89,200.05	108,393.56
2.托管费		17,839.98	21,678.70
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		4,533.62	4,544.23
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		506.28	94.72
7.其他费用		97,141.13	110,095.15
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		8,582,438.33	-5,985,910.40
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		8,582,438.33	-5,985,910.40

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	19,952,472.00	10,723,319.09	30,675,791.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,582,438.33	8,582,438.33
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)	-1,500,000.00	-1,601,863.32	-3,101,863.32
其中:1.基金申购款	4,000,000.00	3,447,108.49	7,447,108.49
2.基金赎回款	-5,500,000.00	-5,048,971.81	-10,548,971.81
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)	18,452,472.00	17,703,894.10	36,156,366.10
项目	上年度可比期间 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)	23,952,472.00	19,971,320.17	43,923,792.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,985,910.40	-5,985,910.40
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)	-5,000,000.00	-3,349,727.62	-8,349,727.62
其中:1.基金申购款	13,000,000.00	10,433,083.13	23,433,083.13
2.基金赎回款	-18,000,000.00	-13,782,810.75	-31,782,810.75
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)	18,952,472.00	10,635,682.15	29,588,154.15

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:朱威,会计机构负责人:朱威

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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	4,337,581.04	100.00%	-	-

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 2019年1月1日至2019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	1,871.13	100.00%	1,487.10	22.52%
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	89,200.05	108,393.56

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,839.98	21,678.70

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。

6.4.4.2.3销售服务费

无。

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2019年6月30日		上年度末2018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	604,341.00	3.28%	260,379.00	1.30%

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国建设银行活期存款	751,186.82	2,376.12	650,839.67	2,496.48

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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:4,938,000.00元(上年度可比期间:15,639,000.00元),支付给中信期货的佣金为:242.09元(上年度可比期间为:383.15元)。

6.4.5期末(2019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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-06	新发流通受限	3.46	3.46	9,691	33,530.86	33,530.86	-

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2019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35,038,842.13元,第二层次的余额为0元,第三层次的余额为0元。(截至2018年12月31日止:第一层次的余额为29,925,897.43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

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	35,038,842.13	96.61
	其中:股票	35,038,842.13	96.61
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	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,140,135.59	3.14
8	其他各项资产	88,046.00	0.24
9	合计	36,267,023.72	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	23,621.70	0.07
C	制造业	18,867.11	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,899.12	0.05
J	金融业	32,782,872.84	90.67
K	房地产业	2,196,581.36	6.08
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	35,038,842.13	96.91

7.3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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	62,910	5,574,455.10	15.42
2	600036	招商银行	109,581	3,942,724.38	10.90
3	601166	兴业银行	154,733	2,830,066.57	7.83
4	600