

# 中小企业板交易型开放式指数基金

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(或基金经理小组) |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|----------|--------------------|------|--------|---|
|    |          | 任职日期               | 离职日期 |        |   |
| 王景 | 本基金的基金经理 | 2016-11-10         | -    | 16年    | 清华大学工学硕士,曾任招商证券资产管理部研究员,期间从事证券资产管理,2009年加入华夏基金管理有限公司,曾任华夏基金基金经理助理,2012年起任华夏基金基金经理,2016年11月10日任本基金的基金经理。 |

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》、《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》、《基金管理人开展投资、研究活动的内控、安全高效的原则管理》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组合,制定并严格执行相应的制度和流程,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《证券投资基金管理人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场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的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中小企业板指数,中小企业板指数由中小企业板中规模大、流动性好、最具代表性的100只股票组成,自2006年1月24日起正式发布,以综合反映中小企业板市场整体表现,其作为中小企业板的核心指数,兼具价值尺度与投资标的功能。本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整。

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,财政政策维持鸽派。国内方面,经济行业整体保持在合理区间,1季度经济弱企稳,GDP同比增长6.4%,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,也保持了改革战略定力、通胀压力,受鲜果、猪肉价格上涨影响,CPI维持高位。

市场方面,年初受经济弱企稳、货币政策宽松、中美贸易谈判重启、外债压力、减税降费等因素影响,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;但随着二季度中美贸易摩擦加剧,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接管一事引发市场波动后及时出手,稳定了市场,市场将逐渐转弱。

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,经深圳证券交易所同意,部分证券资产被确认为本基金的流动性资产。目前,本基金的流动性服务商包括方正证券股份有限公司、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2.792元,本报告期份额净值增长率为21.60%,同期业绩比较基准增长率为20.75%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.85%,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、指数跟踪调整、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,全球经济增长料将继续回落态势,美国大选周期的调整将对全球贸易战的未来走向、贸易规则的重组、利益格局的调等等…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已过去,但税收关注度及美国国内政策对经济本身的影响仍在不断加剧之中,未来不排除出现另一番全新的局面。

中小企业股票具有明显的成长性优势和长期投资价值,但经济形势及市场的变化也会对中小企业公司产生影响,中小企业股票的投资性相对较大。我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,以实现在为投资者获取指数投资收益及其他模式盈利机会的投资目标。

增强基金持有人利益的每一分投资和每一份责任,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  
根据中国证监会及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,制定了估值政策和估值程序,设有完善的业务管理制度,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。本基金托管人向本基金管理人采用的估值程序及技术,并复核,审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对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流动性风险的说明  
本基金基金合同约定,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,当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率时,即可进行收益分配。在符合上述基金合同约定的条件下,本基金收益每年最多分配2次,基金收益分配比例不得低于符合上述基金分配条件的可分配部分的90%。本基金收益分配采取现金方式。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

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,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,本托管人按照相关法律法规、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核对,对本基金的净值变动方向进行了监督,未发现基金管理人有关基金估值和份额净值计价行为。

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内容的真实、准确和完整发表意见  
本托管人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。

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:中小企业板交易型开放式指数基金  
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资产                | 期末               | 本期末              | 上年度末             |
|-------------------|------------------|------------------|------------------|
|                   | 2019年6月30日       | 2019年6月30日       | 2018年12月31日      |
| 货币资金              | 13,585,290.00    | 14,010,258.00    | 14,010,258.00    |
| 结算备付金             | 30,632.00        | 30,632.00        | 30,632.00        |
| 存出保证金             | 1,311,620.00     | 1,311,620.00     | 1,311,620.00     |
| 应收利息              | 2,397,317.30     | 1,966,203.63     | 1,966,203.63     |
| 应收股利              | 2,397,317.30     | 1,966,203.63     | 1,966,203.63     |
| 其他应收款             | -                | -                | -                |
| 其他流动资产            | -                | -                | -                |
| 流动资产合计            | 18,693,882.30    | 18,693,882.30    | 18,693,882.30    |
| 非流动资产             | -                | -                | -                |
| 可供出售金融资产          | -                | -                | -                |
| 持有至到期投资           | -                | -                | -                |
| 长期股权投资            | -                | -                | -                |
| 投资性房地产            | -                | -                | -                |
| 固定资产              | -                | -                | -                |
| 无形资产              | -                | -                | -                |
| 递延所得税资产           | -                | -                | -                |
| 其他非流动资产           | -                | -                | -                |
| 非流动资产合计           | -                | -                | -                |
| 资产总计              | 18,693,882.30    | 18,693,882.30    | 18,693,882.30    |
| 负债和所有者权益(或股东权益)   |                  |                  |                  |
| 负债:               |                  |                  |                  |
| 应付账款              | -                | -                | -                |
| 应付利息              | -                | -                | -                |
| 应付股利              | -                | -                | -                |
| 其他应付款             | -                | -                | -                |
| 其他流动负债            | -                | -                | -                |
| 非流动负债             | -                | -                | -                |
| 负债合计              | -                | -                | -                |
| 所有者权益(或股东权益):     |                  |                  |                  |
| 实收资本              | 2,311,267,966.66 | 2,311,267,966.66 | 2,311,267,966.66 |
| 未分配利润             | 1,588,120,915.64 | 1,588,120,915.64 | 1,588,120,915.64 |
| 所有者权益(或股东权益)合计    | 3,900,388,882.30 | 3,900,388,882.30 | 3,900,388,882.30 |
| 负债和所有者权益(或股东权益)总计 | 3,900,388,882.30 | 3,900,388,882.30 | 3,900,388,882.30 |

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值2.792元,基金份额总额827,315,090.11份。

6.2利润表

会计主体:中小企业板交易型开放式指数基金  
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                | 期末                   | 本期                   | 上年同期                 |
|-------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
|                   | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 一、收入              | 460,426,416.40       | -568,197,488.00      | 728,387,297.00       |
| 1.利息收入            | 40,788,617.61        | 40,788,617.61        | 40,788,617.61        |
| 其中:债券利息收入         | 50,729.40            | 126,064.00           | 126,064.00           |
| 存款利息收入            | 2,212.00             | 2,212.00             | 2,212.00             |
| 资产支持证券利息收入        | -                    | -                    | -                    |
| 买入返销金融资产收入        | -                    | -                    | -                    |
| 其他利息收入            | -                    | -                    | -                    |
| 2.股息收入            | -                    | -                    | -                    |
| 其中:股票股息收入(“净损益”)  | -480,203,670.00      | -4,420,280.00        | -                    |
| 其他股息收入            | -                    | -                    | -                    |
| 3.公允价值变动收益        | 589,363.34           | 1,128,380.00         | -                    |
| 资产支持证券公允价值变动收益    | -                    | -                    | -                    |
| 其他公允价值变动收益        | -                    | -                    | -                    |
| 4.其他综合收益          | -                    | -                    | -                    |
| 5.其他              | -                    | -                    | -                    |
| 二、费用              | 1,196,010,000.00     | 2,384,096,713.60     | 3,319,097,719.50     |
| 其中:1.基金管理费        | 18,479,270.00        | 35,284,260.00        | 50,424,260.00        |
| 2.基金托管费           | 3,081,650.00         | 6,263,100.00         | 8,747,450.00         |
| 3.销售服务费           | 540,921,530.00       | 1,102,341,670.00     | 1,541,671,670.00     |
| 4.其他              | 566,368.00           | 1,135,766.00         | 1,600,870.00         |
| 三、利润总额(亏损总额)“净损益” | -735,583,583.60      | -2,943,670,300.00    | -2,590,710,422.50    |
| 四、净利润(净收益)“净利润”   | -735,583,583.60      | -2,943,670,300.00    | -2,590,710,422.50    |
| 五、其他综合收益          | -                    | -                    | -                    |
| 六、综合收益总额          | -735,583,583.60      | -2,943,670,300.00    | -2,590,710,422.50    |
| 七、每股收益            |                      |                      |                      |
| 基本每股收益            | -                    | -                    | -                    |
| 稀释每股收益            | -                    | -                    | -                    |

6.3所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:中小企业板交易型开放式指数基金  
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                      | 2019年1月1日         | 本期                | 2019年6月30日        | 所有者权益合计           |
|-------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)         | 460,426,416.40    | 1,130,207,371.76  | 1,690,633,788.16  | 1,690,633,788.16  |
| 二、本期损益                  | -                 | -2,943,670,300.00 | -2,943,670,300.00 | -2,943,670,300.00 |
| 三、本期基金份额变动产生的净损益(“净损益”) | -                 | -26,744,913.81    | -123,443,719.54   | -123,443,719.54   |
| 其中:1.基金申购               | 1,196,010,000.00  | 2,184,096,713.60  | 3,319,097,719.50  | 3,319,097,719.50  |
| 其中:1.1基金申购              | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 2.基金赎回                  | -1,196,776,381.84 | -2,384,196,416.20 | -3,482,341,481.13 | -3,482,341,481.13 |
| 四、其他综合收益                | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)         | 460,426,416.40    | 1,402,328,430.52  | 2,369,481,728.02  | 2,369,481,728.02  |

单位:人民币元

| 项目                      | 2019年1月1日       | 本期               | 2019年6月30日        | 所有者权益合计           |
|-------------------------|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,807,652,702.60 | 2,528,663,724.74  | 2,528,663,724.74  |
| 二、本期损益                  | -               | -387,130,728.60  | -387,130,728.60   | -387,130,728.60   |
| 三、本期基金份额变动产生的净损益(“净损益”) | -               | 35,651,804.02    | 64,444,528.36     | 99,076,332.38     |
| 其中:1.基金申购               | 303,600,000.00  | 614,028,202.76   | 1,277,628,202.76  | 1,277,628,202.76  |
| 其中:1.1基金申购              | -               | -                | -                 | -                 |
| 2.基金赎回                  | -303,600,000.00 | -614,028,202.76  | -1,277,628,202.76 | -1,277,628,202.76 |
| 四、其他综合收益                | -               | -                | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,420,521,974.00 | 2,627,740,056.12  | 2,627,740,056.12  |

单位:人民币元

| 项目                      | 2019年1月1日       | 本期               | 2019年6月30日        | 所有者权益合计           |
|-------------------------|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,807,652,702.60 | 2,528,663,724.74  | 2,528,663,724.74  |
| 二、本期损益                  | -               | -387,130,728.60  | -387,130,728.60   | -387,130,728.60   |
| 三、本期基金份额变动产生的净损益(“净损益”) | -               | 35,651,804.02    | 64,444,528.36     | 99,076,332.38     |
| 其中:1.基金申购               | 303,600,000.00  | 614,028,202.76   | 1,277,628,202.76  | 1,277,628,202.76  |
| 其中:1.1基金申购              | -               | -                | -                 | -                 |
| 2.基金赎回                  | -303,600,000.00 | -614,028,202.76  | -1,277,628,202.76 | -1,277,628,202.76 |
| 四、其他综合收益                | -               | -                | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,420,521,974.00 | 2,627,740,056.12  | 2,627,740,056.12  |

单位:人民币元

| 项目                      | 2019年1月1日       | 本期               | 2019年6月30日        | 所有者权益合计           |
|-------------------------|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,807,652,702.60 | 2,528,663,724.74  | 2,528,663,724.74  |
| 二、本期损益                  | -               | -387,130,728.60  | -387,130,728.60   | -387,130,728.60   |
| 三、本期基金份额变动产生的净损益(“净损益”) | -               | 35,651,804.02    | 64,444,528.36     | 99,076,332.38     |
| 其中:1.基金申购               | 303,600,000.00  | 614,028,202.76   | 1,277,628,202.76  | 1,277,628,202.76  |
| 其中:1.1基金申购              | -               | -                | -                 | -                 |
| 2.基金赎回                  | -303,600,000.00 | -614,028,202.76  | -1,277,628,202.76 | -1,277,628,202.76 |
| 四、其他综合收益                | -               | -                | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,420,521,974.00 | 2,627,740,056.12  | 2,627,740,056.12  |

单位:人民币元

| 项目                      | 2019年1月1日       | 本期               | 2019年6月30日        | 所有者权益合计           |
|-------------------------|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,807,652,702.60 | 2,528,663,724.74  | 2,528,663,724.74  |
| 二、本期损益                  | -               | -387,130,728.60  | -387,130,728.60   | -387,130,728.60   |
| 三、本期基金份额变动产生的净损益(“净损益”) | -               | 35,651,804.02    | 64,444,528.36     | 99,076,332.38     |
| 其中:1.基金申购               | 303,600,000.00  | 614,028,202.76   | 1,277,628,202.76  | 1,277,628,202.76  |
| 其中:1.1基金申购              | -               | -                | -                 | -                 |
| 2.基金赎回                  | -303,600,000.00 | -614,028,202.76  | -1,277,628,202.76 | -1,277,628,202.76 |
| 四、其他综合收益                | -               | -                | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,420,521,974.00 | 2,627,740,056.12  | 2,627,740,056.12  |

单位:人民币元

| 项目                      | 2019年1月1日       | 本期               | 2019年6月30日        | 所有者权益合计           |
|-------------------------|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,807,652,702.60 | 2,528,663,724.74  | 2,528,663,724.74  |
| 二、本期损益                  | -               | -387,130,728.60  | -387,130,728.60   | -387,130,728.60   |
| 三、本期基金份额变动产生的净损益(“净损益”) | -               | 35,651,804.02    | 64,444,528.36     | 99,076,332.38     |
| 其中:1.基金申购               | 303,600,000.00  | 614,028,202.76   | 1,277,628,202.76  | 1,277,628,202.76  |
| 其中:1.1基金申购              | -               | -                | -                 | -                 |
| 2.基金赎回                  | -303,600,000.00 | -614,028,202.76  | -1,277,628,202.76 | -1,277,628,202.76 |
| 四、其他综合收益                | -               | -                | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14  | 1,420,521,974.00 | 2,627,740,056.12  | 2,627,740,056.12  |

单位:人民币元

| 项目                      | 2019年1月1日      | 本期               | 2019年6月30日       | 所有者权益合计          |
|-------------------------|----------------|------------------|------------------|------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)         | 721,011,022.14 | 1,807,652,702.60 | 2,528,663,724.74 | 2,528,663,724.74 |
| 二、本期损益                  | -              | -387,130,728.60  | -387,130,728.60  | -387,130,728.60  |
| 三、本期基金份额变动产生的净损益(“净损益”) | -              | 35,651,804.02    | 64,444,528.36    | 99,076,332.38    |
| 其中:1.基金申购               | 303,600,000.00 | 614,028,202.76   | 1,277,628,202.76 | 1,2              |