

华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

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

重要提示
基金管理人、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。

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仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

2.1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
基金代码:001316

2.2基金产品说明
基金的投资目标:跟踪恒生综合大型股指数的净值表现。
基金的投资策略:本基金主要采用完全复制法跟踪恒生综合大型股指数的净值表现。

2.3基金管理人及基金托管人
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

2.4境外资产托管人
名称:摩根大通
住所:美国纽约

2.5信息披露方式
基金管理人网站:www.ChinaAMC.com
基金托管人网站:www.abchina.com

3.1主要会计数据和财务指标
基金净值:41,055,118.48元
基金份额净值:1.0000元

3.2基金业绩比较基准
业绩比较基准:恒生综合大型股指数收益率*95%+人民币活期存款利率*5%

3.3基金管理人及基金托管人
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

3.4基金业绩比较基准
业绩比较基准:恒生综合大型股指数收益率*95%+人民币活期存款利率*5%

3.5基金管理人及基金托管人
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

3.6基金管理人及基金托管人
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

3.7基金管理人及基金托管人
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

3.8基金管理人及基金托管人
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

3.9基金管理人及基金托管人
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

3.10基金管理人及基金托管人
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

3.11基金管理人及基金托管人
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

3.12基金管理人及基金托管人
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

3.13基金管理人及基金托管人
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

3.14基金管理人及基金托管人
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

3.15基金管理人及基金托管人
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

3.16基金管理人及基金托管人
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

3.17基金管理人及基金托管人
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

3.18基金管理人及基金托管人
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

3.19基金管理人及基金托管人
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

3.20基金管理人及基金托管人
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

3.21基金管理人及基金托管人
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

3.22基金管理人及基金托管人
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

3.23基金管理人及基金托管人
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

3.24基金管理人及基金托管人
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

3.25基金管理人及基金托管人
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

3.26基金管理人及基金托管人
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

3.27基金管理人及基金托管人
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

3.28基金管理人及基金托管人
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

3.29基金管理人及基金托管人
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

3.30基金管理人及基金托管人
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

3.31基金管理人及基金托管人
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

发生较大变化。美联储暗示了未来降息的可能性,国内经济数据维持弱势,进出口数据低于预期。政府持续推出稳增长政策,包括大幅减税降费以及专项债的扩容,信贷增速、社融增速反弹,市场利率明显下行。本报告期,期中中美贸易摩擦局势预期好转,恒生指数出现较大幅度的上涨,随后中美贸易摩擦升级,恒生指数随即出现回调。

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。

截至2019年6月30日,本基金份额净值为2.6595元,本报告期份额净值增长率为11.67%,同期经汇率净值调整的业绩比较基准增长率为10.87%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.80%,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。

展望下半年,宏观经济及美国经济增长速度的预期增加,美联储货币政策转向更为明确,大概率会降息。国内方面,政府将继续出台稳增长政策对冲经济下滑,随着政策效果的逐步显现,国内经济增速、企业盈利或将将在下半年企稳回升。

市场方面,目前股债市场的估值水平处在历史较低水平,具备良好的投资价值。如有国内经济企稳回升,恒生指数有望继续震荡上行,若中美贸易摩擦升级超预期,或中国经济下滑超预期,市场则会呈现震荡走势。

本基金将会根据基金合同要求,在紧密跟踪标的指数的基础上,做好成份股调整,应对申购赎回、限制股票替代等工作,并力争与业绩跟踪目标保持一致。

珍惜基金份额持有人的一部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“为信任回报服务”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管理人及基金托管人
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

4.7基金管理人及基金托管人
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

4.8基金管理人及基金托管人
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

4.9基金管理人及基金托管人
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

4.10基金管理人及基金托管人
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

4.11基金管理人及基金托管人
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

4.12基金管理人及基金托管人
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

4.13基金管理人及基金托管人
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

4.14基金管理人及基金托管人
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

4.15基金管理人及基金托管人
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

4.16基金管理人及基金托管人
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

4.17基金管理人及基金托管人
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

4.18基金管理人及基金托管人
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

4.19基金管理人及基金托管人
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

4.20基金管理人及基金托管人
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

4.21基金管理人及基金托管人
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

4.22基金管理人及基金托管人
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

4.23基金管理人及基金托管人
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

4.24基金管理人及基金托管人
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

4.25基金管理人及基金托管人
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

4.26基金管理人及基金托管人
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

4.27基金管理人及基金托管人
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

4.28基金管理人及基金托管人
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

4.29基金管理人及基金托管人
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

4.30基金管理人及基金托管人
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

4.31基金管理人及基金托管人
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

4.32基金管理人及基金托管人
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

4.33基金管理人及基金托管人
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

4.34基金管理人及基金托管人
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

4.35基金管理人及基金托管人
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

4.36基金管理人及基金托管人
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

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交易
6.4.4.1.1股票交易

Table with columns: 关联方名称, 交易金额, 占期末总资产比例, 占期末净资产比例, 占期末总资产比例, 占期末净资产比例

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基金交易
无
6.4.4.1.6支付关联方的佣金
6.4.4.1.6.1支付关联方的佣金

Table with columns: 关联方名称, 交易金额, 占期末总资产比例, 占期末净资产比例, 占期末总资产比例, 占期末净资产比例

注:上述佣金按市场公允价值计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证券管理费、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

Table with columns: 期间, 基金管理人报酬, 基金托管人报酬, 销售服务费

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,逐日累计至每月月末,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

Table with columns: 期间, 基金托管人报酬, 销售服务费

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,逐日累计至每月月末,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。
6.4.4.2.3基金托管费

Table with columns: 期间, 基金托管人报酬, 销售服务费

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,逐日累计至每月月末,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。
6.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券交易
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
6.4.4.4.2报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.4.3报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.4.4报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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
基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.6基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.7基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.8基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.9基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.10基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.11基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.12基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.13基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.14基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.15基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.16基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.17基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.18基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.19基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.20基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.21基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.22基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.23基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.24基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.25基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.26基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.27基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.28基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.29基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.30基金管理人及基金托管人
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

6.4.4.31基金管理人及基金托管人
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

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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占期末总资产比例, 占期末净资产比例

注:“买入金额”按买入成交金额(成交价款以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额, 占期末总资产比例, 占期末净资产比例

注:“卖出金额”按卖出成交金额(成交价款以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
7.5.3权益投资的买入成本及卖出收入总额

Table with columns: 买入成本, 卖出收入

7.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。
7.7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。
7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。
7.9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。
7.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细
本基金本报告期末未持有基金。
7.11投资组合报告附注

7.11.1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、处罚的情况。
7.11.2本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票名单。
7.11.3期末其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额, 占基金资产净值比例

7.11.4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。
7.11.5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。
7.11.6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。
§8基金投资组合持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with columns: 持有人户数(户), 户内持有基金份额占基金总份额比例, 机构投资者持有基金份额, 个人投资者持有基金份额

8.2期末上市基金前十名持有人

Table with columns: 序号, 持有人名称, 持有基金份额, 占上市基金份额比例

8.3期末基金管理人及基金托管人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 基金管理人持有基金份额, 基金托管人持有基金份额

8.4期末基金管理人及基金托管人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 基金管理人持有基金份额, 基金托管人持有基金份额

§9开放式基金份额变动

Table with columns: 基金份额变动, 基金份额

§10重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议
本报告期间,本基金未召开基金份额持有人大会。
10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部(组)的重大人事变动
本基金管理人于2019年3月2日发布公告,李彬女士担任华夏基金管理有限公司督察长,周敏女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。
10.3涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产估值业务的诉讼
本基金报告期内涉及基金管理人、基金资产、基金估值业务的诉讼事项。
10.4基金投资策略的改变
本基金本报告期投资策略未发生改变。
10.5与基金进行审计的会计师事务所情况
报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。
10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。
10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

Table with columns: 券商名称, 交易席位名称, 成交金额, 占期末总资产比例, 占期末净资产比例, 佣金

注:①股票投资的公允价值包含可替代存款的估值增值。
本基金本报告期末通过沪港通机制投资香港股票的投资金额为697,858,265.05元,占基金资产净值比例为96.12%。
7.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

Table with columns: 国家/地区, 投资金额, 占基金资产净值比例

7.3期末按行业分类的权益投资明细

Table with columns: 行业名称, 投资金额, 占基金资产净值比例

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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

注:①所用证券代码均用当地市场代码。
投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细,应阅读载于本基金管理人的半年度报告正文。
§11影响投资者决策的其他重要信息

Table with columns: 序号, 事项名称, 发生日期, 影响程度

11.1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

Table with columns: 投资者名称, 持有基金份额, 占基金资产净值比例

11.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with columns: 券商名称, 成交金额, 占期末总资产比例, 占期末净资产比例, 佣金