

**华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数**

**证券投资基金**

**2019 年年度报告**

**2019 年 12 月 31 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年四月九日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 7 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 审计报告.....	13
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
§8 投资组合报告.....	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
8.6 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.....	58
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	58
8.8 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贵金属投资明细.....	59
8.9 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.....	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
8.13 投资组合报告附注.....	60
§9 基金份额持有人信息.....	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	61
§10 开放式基金份额变动.....	62
§11 重大事件揭示.....	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§13 备查文件目录.....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCIA 股（扩位证券简称：MSCIA 股 ETF）
基金主代码	512990
交易代码	512990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 17 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	442,621,733.00 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

### 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	MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66594319
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2019 年	2018 年 9 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	99,967,183.93	-11,185,255.93
本期利润	198,095,351.35	-32,329,065.98
加权平均基金份额本期利润	0.4055	-0.0556
本期加权平均净值利润率	36.41%	-5.92%
本期基金份额净值增长率	40.75%	-6.12%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	113,544,672.18	-64,671,729.80
期末可供分配基金份额利润	0.2565	-0.1073
期末基金资产净值	556,166,405.18	537,831,517.20
期末基金份额净值	1.2565	0.8927
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	32.14%	-6.12%

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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	8.23%	0.72%	7.83%	0.72%	0.40%	0.00%
过去六个月	11.33%	0.84%	7.76%	0.84%	3.57%	0.00%
过去一年	40.75%	1.21%	35.25%	1.21%	5.50%	0.00%
自基金转型起至今	32.14%	1.30%	27.53%	1.31%	4.61%	-0.01%

### 3.2.2 自基金转型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

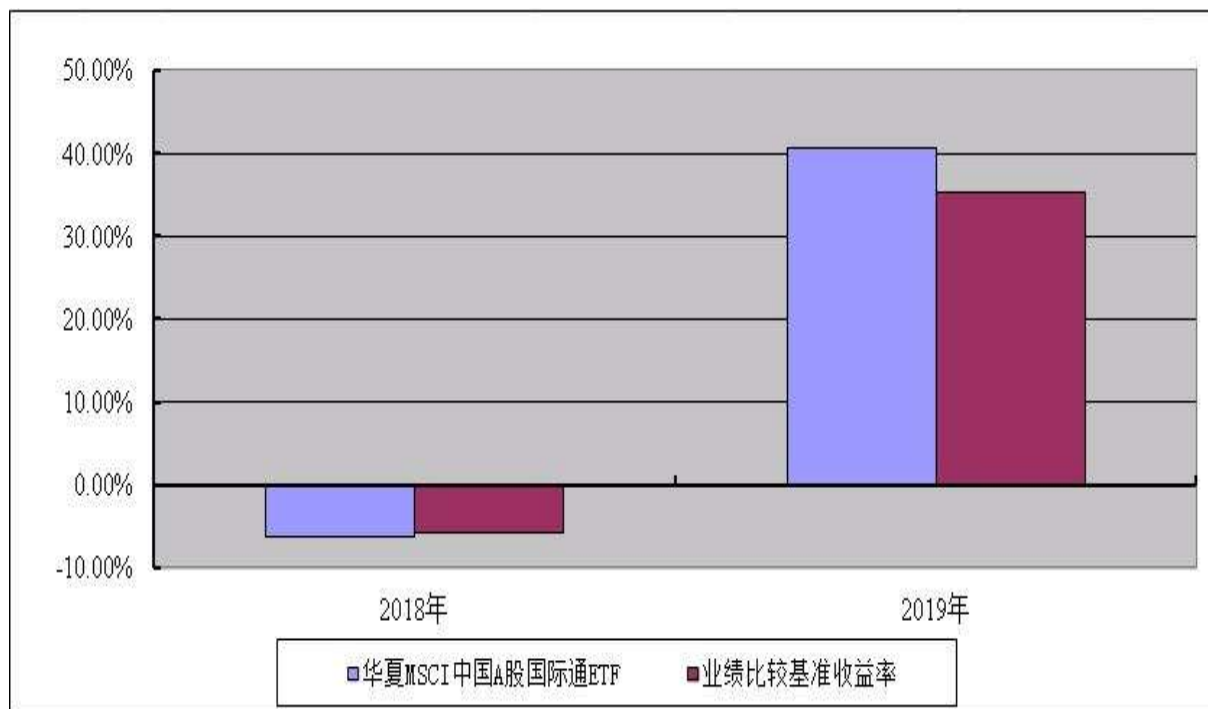
华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2018 年 9 月 17 日至 2019 年 12 月 31 日)



注：根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2018 年 9 月 17 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## §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，首批商品期货 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、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 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、信用债指数、商品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，2019 年在基金分类排名中（截至 2019 年 12 月 31 日数据），华夏鼎沛债券在“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 3/224；华夏聚利债券在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（A 类）”中排序 5/165；华夏可转债增强债券(A 类)在“债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金（A 类）”中排序 9/28；华夏债券(C 类)及华夏双债债券(C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债)(非 A 类)”中分别排序 5/105 和 3/105；华夏鼎利债券 (C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（非 A 类）”中排序 8/160；华夏收益债券（QDII）（A 类)在“QDII 基金-QDII 债券基金-QDII 债券型基金（非 A 类）”中排序 6/21；华夏医疗健康混合(C 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（非 A 类）”中排序 4/18；华夏移动互联混合(QDII)及华夏全球科技先锋混合(QDII)在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 2/33 和 6/33；华夏上证 50AH 优选指数（LOF）（C 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（非 A 类）”中排序 4/11；华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 6/60；华夏消费 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”排序 5/31；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 6/31；华夏创业板 ETF 联接（A 类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中排序 5/46。

在客户服务方面，2019 年，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，客户直接说出问题即可查询账户交易和基金信息，同时系统还可进行身份信息认证，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）华夏基金管家 APP、华夏基金微信公众号上线智能快取功能，满足了广大投资者对资金流动的迫切需求；（3）华夏基金上线微信账单服务，方便客户详细、准确查询账户持有及交易明细情况，同时华夏基金净值服务全面升级为微信实时查看、订阅推送模式，方便客户及时、精准查询基金净值变动情况；（4）与微众银行、五矿证券、阳光人寿、英大证券等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（5）开展“你的户口本更新了”、“户龄”、“微



信全勤奖”、“寻人启事”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）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2018-09-17	-	9 年	北京大学光华管理学院会计学硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理，MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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,本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(1日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 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 MSCI 中国 A 股国际通指数, MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index)由 MSCI 公司于 2017 年 10 月 23 日发布,其成份股为 A 股纳入 MSCI 新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index)的部分,该指数能够完整反映 A 股逐步纳入 MSCI 新兴市场指数的进程。截至 2019 年 12 月 31 日, MSCI 中国 A 股国际通指数成份股 465 只。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。

2019 年上半年,国际方面,世界经济增长、国际贸易增长动能继续放缓,下行压力倍增,海外货币政策取向已有所松动,美联储释放出更多鸽派信号,降息概率明显上升,部分新兴市场国家已经进入降息通道。国内方面,1 季度政策全面放松,央行释放流动性,宽货币向宽信用传导出现良好迹象。绝大多数宏观经济指标的表现比较平稳,一部分指标趋势向好,从投资、消费数据来看,国内需求呈现稳中有升的态势;从生产端及需求端数据来看,3 月制造业 PMI 超预期回升,重回荣枯线上方,经济结构优化的趋势在延续。2 季度中美贸易冲突升级并延伸至技术、金融领域,中国经济面临来自外围环境的压力。国内货币政策维持平稳,部分中小银行同业风险对金融市场信用偏好造成不利影响,后央行批量调整头部券商短融余额上限,以此传导流动性,市场压力得到缓解。2019 年下半年,世界经济复苏仍旧乏力,外部不确定性因素持续增加,美国经济相对稳健,但制造

业 PMI、消费者信心指数等显示美经济已现下降迹象，欧元区经济低迷，日本经济增速回落，英国仍受脱欧不确定性拖累；新兴市场经济体经济表现相对分化，但亦呈疲软趋势。鉴于此，欧洲央行重启量化宽松政策，美联储也开启了年内第二次降息，全球主要经济体货币政策都趋于宽松。国内方面，3 季度国际环境不稳定不确定因素明显增多，国内经济结构性矛盾依然突出，经济下行压力加大。但经济的下行压力和货币的乐观预期互相形成对冲，9 月初，国内再次降准。整体上国民经济运行处在合理区间，结构优化态势没有变，稳中有进的态势仍然在持续。在 4 季度降息、降准、社融扩张、完善 FAI 项目资本金制度等一系列稳增长政策效应的作用下，经济运行出现了积极变化，走势边际企稳，11 月 PMI 明显回升到荣枯线之上，2020 年提前批专项债额度已经下达，对经济增长预期形成支撑。

市场方面，在经历了 2018 年的大跌之后，1 季度 A 股市场喜迎开门红，上证综指快速反弹至 3000 点上方，沪深两市成交金额突破了万亿元。政策环境转暖、外资等长期资金涌入等促使 A 股市场投资者情绪逐步高涨，估值低、弹性较大的中小盘风格指数补涨反弹势力最为强劲。4 月，A 股指数在流动性修复边际递减、中美贸易摩擦等因素下出现一定幅度回调。而后，在国内经济金融领域结构调整积极变化预期下，以及 MSCI 和 FTSE 提高 A 股在全球股票指数占比，北向资金加速流入 A 股布局等因素作用下，市场信心得到修复，A 股指数再度企稳回升。3 季度，市场呈先抑后扬走势，最低下探至 2733.92 点。8 月随着中美贸易摩擦的发酵，受单边主义和贸易保护主义措施及对中国加征关税预期等影响，人民币兑美元汇率承压，并在 8 月 5 日跌破“7”关口。8 月底，MSCI 纳入 A 股比例再次边际提升 5%，9 月，标普道琼斯指数纳入 A 股的决定首次生效，富时罗素 A 股纳入计划第一阶段的第二步也同步进行，随着国际指数纳入 A 股和扩容加速、国家外汇管理局决定取消 QFII 和 RQFII 投资额度限制，外资流入速度显著提升。国内市场受政策利好等情绪共振，小牛市气氛活跃，中小盘成长股和科技创新型行业反弹力度显著。随着 MSCI 指数 A 股年内最大单次扩容 11 月顺利实施，北上资金继续趋势性流入 A 股市场，A 股市场 4 季度整体震荡向上，结构化行情特征明显，在年末效应影响下，低估值蓝筹表现相对突出。

基金投资运作方面，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、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、方正证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司等。

目前该基金已被调入融资融券标的证券名单。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.2565 元，本报告期份额净值增长率为 40.75%，同期业绩比较基准增长率 35.25%。本基金本报告期跟踪偏离度为+5.50%，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 2020 年，过去一年发达经济体和新兴市场经济体大规模货币宽松的效果预计将在 2020 年继续对全球经济产生影响，需要警惕的是净供给冲击可能带来长期经济增速放缓和通胀上升持续并存的局面。新冠肺炎疫情改变全球经济节奏，但防疫情、稳增长的逆周期政策节奏和力度都会超预期，经济走势全年或将呈现“深 V 反转”形态。

市场方面，在全球央行普遍降息提振作用的基础上，全球权益市场的风险溢价目前整体仍处于合理水平。市场对新冠肺炎疫情的观点从事件性冲击演变为对实体经济确定性下行的担忧，鉴于逆周期维稳等预期，市场波动后投资者参与热情极高，考虑到 A 股市场目前估值处于合理区间，景气度高的企业盈利增速仍处于反弹上行阶段，流动性环境边际改善，在增量资金流入下，股票市场仍以结构性牛市趋势为主，全年部分受疫情影响较小的板块仍然会呈现较好的投资机会。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司紧密跟踪法律法规和监管要求，防控各类合规风险，促进公司各项业务合法合规；持续完善内部制度建设，制定或修订了廉洁从业管理、沃尔克规则合规政策、子公司管理、信息披露管理等多项内部制度；根据资管新规要求，制定相应整改计划时间表，组织开展整改工作；公司以投资研究和销售业务条线为重点，围绕投资违规、投资者适当性管理等监管重点方向开展合规培训，不断提升员工的合规守法意识；强化事前事中合规风险管理，对信息披露文件严格把关，认真审核基金宣传推介材料，加强销售行为管理。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，在持续对日常投资运作进行监督的同时，加强对基金流动性风险的管理、投资组合强制合规管理，督促投研交易业务的合规开展，努力确保各项风险管理制度落实到位；公司以数据驱动为基础，加强内部风险管理系统建设，推动实现投资决策与风险管理的全面整合。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，对资产管理计划业务和分支机构业务进行检查监督，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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，本基金管理人作为准确、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融

工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第 21367 号

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人:

### 6.1 审计意见

#### (1) 我们审计的内容

我们审计了华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### (2) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金的财务报告过程。

#### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

单峰 程红粤

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

2020 年 4 月 7 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,606,439.56	8,876,415.53
结算备付金		4,912,205.20	4,854,104.57
存出保证金		1,311,483.80	1,256,567.78
交易性金融资产	7.4.7.2	543,574,713.90	523,620,445.70
其中：股票投资		542,979,713.90	523,502,843.90
基金投资		-	-
债券投资		595,000.00	117,601.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,368,255.59	4,950.20
应收利息	7.4.7.5	10,957.46	5,112.85
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		561,784,055.51	538,617,596.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,760,625.35	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		236,497.52	229,009.54
应付托管费		47,299.50	45,801.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	260,111.10	171,543.33



应交税费		3,374.08	0.34
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,309,742.78	339,724.28
负债合计		5,617,650.33	786,079.43
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	442,621,733.00	602,503,247.00
未分配利润	7.4.7.10	113,544,672.18	-64,671,729.80
所有者权益合计		556,166,405.18	537,831,517.20
负债和所有者权益总计		561,784,055.51	538,617,596.63

注：①报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2565 元，基金份额总额 442,621,733.00 份。

②自 2018 年 9 月 17 日起，原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金转型为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金，上年度可比期间自 2018 年 9 月 17 日至 2018 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 9 月 17 日（基 金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		202,841,167.07	-31,146,168.01
1.利息收入		182,551.74	57,113.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	172,966.51	56,762.25
债券利息收入		1,032.50	23.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	327.67
证券出借利息收入		8,552.73	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		103,535,013.03	-10,095,258.57
其中：股票投资收益	7.4.7.12	89,098,905.11	-9,367,060.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	468,481.97	2,988.24
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	3,148,951.45	-985,049.84

股利收益	7.4.7.17	10,818,674.50	253,863.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	98,128,167.42	-21,143,810.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	995,434.88	35,787.55
<b>减：二、费用</b>		4,745,815.72	1,182,897.97
1.管理人报酬		2,720,409.46	794,887.68
2.托管费		544,081.90	158,977.57
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	1,022,806.66	80,911.78
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		9,475.64	0.08
7.其他费用	7.4.7.21	449,042.06	148,120.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		198,095,351.35	-32,329,065.98
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		198,095,351.35	-32,329,065.98

注：自 2018 年 9 月 17 日起，原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金转型为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金，上年度可比期间自 2018 年 9 月 17 日至 2018 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	602,503,247.00	-64,671,729.80	537,831,517.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	198,095,351.35	198,095,351.35
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）	-159,881,514.00	-19,878,949.37	-179,760,463.37
其中：1.基金申购款	659,706,315.00	96,249,383.91	755,955,698.91
2.基金赎回款	-819,587,829.00	-116,128,333.28	-935,716,162.28
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）	442,621,733.00	113,544,672.18	556,166,405.18
项目	上年度可比期间 2018 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 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）	602,503,247.00	-29,553,433.78	572,949,813.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-32,329,065.98	-32,329,065.98
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）	-	-2,789,230.04	-2,789,230.04
其中：1.基金申购款	82,800,000.00	-5,797,192.25	77,002,807.75
2.基金赎回款	-82,800,000.00	3,007,962.21	-79,792,037.79
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）	602,503,247.00	-64,671,729.80	537,831,517.20

注：自 2018 年 9 月 17 日起，原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金转型为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金，上年度可比期间自 2018 年 9 月 17 日至 2018 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]870 号《关于准予 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交

易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 1 月 19 日至 2015 年 2 月 6 日期间共募集 4,136,470,618.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0145 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,136,570,680 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,062 份基金份额。

根据原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金变更标的指数并修订基金合同有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金自 2018 年 9 月 17 日正式变更为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金；MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金自 2018 年 9 月 17 日正式变更为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并继续以变更后的华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金作为目标 ETF。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

- 1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交

易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；

境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导

意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通



机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	10,606,439.56	8,876,415.53
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	10,606,439.56	8,876,415.53

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	495,428,686.40	542,979,713.90	47,551,027.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	595,000.00	595,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	595,000.00	595,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	496,023,686.40	543,574,713.90	47,551,027.50
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	573,199,765.62	523,502,843.90	-49,696,921.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	118,000.00	117,601.80
	银行间市场	-	-
	合计	118,000.00	117,601.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	573,317,765.62	523,620,445.70	-49,697,319.92
----	----------------	----------------	----------------

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,684,580.00	-	-	-
其中：股指期货	11,684,580.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,684,580.00	-	-	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,393,880.00	-	-	-
其中：股指期货	11,393,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,393,880.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见

下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量 (买/卖) (单位： 手)	合约市值	公允价值变 动	风险说明
IF2006	沪深 300 股 指期货 IF2006 合约	6	7,409,520.00	132,540.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IF2003	沪深 300 股 指期货 IF2003 合约	2	2,471,880.00	144,360.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2001	中证 500 股 指期货 IC2001 合约	1	1,053,360.00	11,240.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实

					现投资目标。
IC2003	中证 500 股指期货 IC2003 合约	1	1,046,320.00	8,360.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理, 实现投资目标。
公允价值变动总额合计					296,500.00
股指期货投资本期收益					3,148,951.45
股指期货投资本期公允价值变动					879,820.00

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,988.56	2,060.12
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,749.69	2,935.06
应收债券利息	68.63	30.77
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	6,115.27	-
其他	35.31	86.90
合计	10,957.46	5,112.85

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	260,111.10	171,543.33
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	260,111.10	171,543.33

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	190,000.00	60,000.00
应付指数使用费	190,428.56	150,115.77
应退替代款	902,946.82	124,818.51
可退替代款	26,367.40	4,790.00
合计	1,309,742.78	339,724.28

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	602,503,247.00	602,503,247.00
本期申购	659,706,315.00	659,706,315.00
本期赎回（以“-”号填列）	-819,587,829.00	-819,587,829.00
本期末	442,621,733.00	442,621,733.00

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	186,902,759.66	-251,574,489.46	-64,671,729.80
本期利润	99,967,183.93	98,128,167.42	198,095,351.35
本期基金份额交易产生的变动数	-58,793,462.30	38,914,512.93	-19,878,949.37
其中：基金申购款	280,688,595.61	-184,439,211.70	96,249,383.91
基金赎回款	-339,482,057.91	223,353,724.63	-116,128,333.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	228,076,481.29	-114,531,809.11	113,544,672.18

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	86,610.39	23,625.69

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	84,871.86	32,359.51
其他	1,484.26	777.05
合计	172,966.51	56,762.25

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年9月17日（基金 合同生效日）至2018年 12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	50,681,106.82	-8,689,995.49
股票投资收益——赎回差价收入	38,417,798.29	-677,065.36
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	89,098,905.11	-9,367,060.85

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年9月17日（基金合 同生效日）至2018年12月 31日
卖出股票成交总额	511,460,023.13	54,685,259.09
减：卖出股票成本总额	460,778,916.31	63,375,254.58
买卖股票差价收入	50,681,106.82	-8,689,995.49

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年9月17日（基金 合同生效日）至2018年 12月31日
赎回基金份额对价总额	889,004,844.36	79,792,037.79
减：现金支付赎回款总额	280,991,581.36	21,709,495.79
减：赎回股票成本总额	569,595,464.71	58,759,607.36
赎回差价收入	38,417,798.29	-677,065.36

#### 7.4.7.13 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年9月17日（基金合 同生效日）至2018年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,344,007.62	36,003.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,874,500.00	33,000.00
减：应收利息总额	1,025.65	14.76
买卖债券差价收入	468,481.97	2,988.24

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.16 贵金属投资收益

7.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 衍生工具收益

7.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年9月17日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
股指期货投资收益	3,148,951.45	-985,049.84
合计	3,148,951.45	-985,049.84

7.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年9月17日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	10,818,674.50	253,863.88
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	10,818,674.50	253,863.88

## 7.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年9月17日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1.交易性金融资产	97,248,347.42	-21,228,399.89
——股票投资	97,247,949.22	-21,226,107.49
——债券投资	398.20	-2,292.40
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	879,820.00	84,589.84
——权证投资	-	-
——期货投资	879,820.00	84,589.84
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	98,128,167.42	-21,143,810.05

## 7.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年9月17日(基金合同生效日)至 2018年12月31日
基金赎回费收入	70,066.98	-
替代损益	922,369.40	35,787.55
其他	2,998.50	-
合计	995,434.88	35,787.55

## 7.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年9月17日(基金合同生效日) 至2018年12月31日
交易所市场交易费用	1,022,806.66	80,911.78



银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,022,806.66	80,911.78

7.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年9月17日（基金合同生效日） 至2018年12月31日
审计费用	70,000.00	17,425.58
信息披露费	120,000.00	23,232.38
证券出借违约金	-	-
银行费用	9,161.96	1,545.69
指数使用费	189,880.10	58,491.63
上市费	60,000.00	17,425.58
其他费用	-	30,000.00
合计	449,042.06	148,120.86

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2018年9月17日（基金合同生效日） 至2018年12月31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	101,337,027.15	10.58%	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 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12月31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	43,707.99	12.44%	33,542.19	12.90%
关联方名称	上年度可比期间 2018年9月17日（基金合同生效日）至2018年12月31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
-	-	-	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年9月17日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,720,409.46	794,887.68
其中：支付销售机构的客户维护费	29,163.89	952.73

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 0.50%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×0.50%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年9月17日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	544,081.90	158,977.57

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 0.10%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×0.10%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2019年1月1日至2019年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	435,660.00	334.88	435,660.00	344.93

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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 12 月 31 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

		例		
华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	197,307,581.00	44.58%	166,957,581.00	27.71%

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。

#### 7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2018年9月17日（基金合同生效日） 至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	10,606,439.56	86,610.39	8,876,415.53	23,625.69

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

①本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 250,858,800.00 元（上年度可比期间：61,946,220.00 元），支付给中信期货的佣金为 6,146.02 元（上年度可比期间：1,517.70 元）。

②于 2019 年 12 月 31 日，本基金(因指数成份股包括中信证券而被动)持有的中信证券股票估值总额为人民币 4,631,924.00 元，占基金资产净值的比例为 0.83%(2018 年 12 月 31 日，本基金(因指数成份股包括中信证券而被动)持有中信证券股票估值总额为人民币 5,186,919.80 元，占基金资产净值的比例为 0.96%)。

③于 2019 年 12 月 31 日，本基金(因指数成份股包括中国银行而被动)持有的中国银行股票估值总额为人民币 2,428,389.00 元，占基金资产净值的比例为 0.44%(2018 年 12 月 31 日，本基金(因指数成份股包括中国银行而被动)持有中国银行股票估值总额为人民币 5,918,234.00 元，占基金资产净值的比例为 1.10%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688388	嘉元科技	2019-07-16	2020-01-22	新发流通受限	28.26	54.90	24,307	686,915.82	1,334,454.30	-
688199	久日新材	2019-10-28	2020-05-06	新发流通受限	66.68	59.66	4,494	299,659.92	268,112.04	-
688358	祥生医疗	2019-11-25	2020-06-03	新发流通受限	50.53	48.96	4,541	229,456.73	222,327.36	-
002466	天齐锂业	2019-12-26	2020-01-03	增发流通受限	8.75	30.18	6,542	57,242.50	197,437.56	-
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-01-06	新发流通受限	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
688369	致远互联	2019-10-23	2020-05-06	新发流通受限	49.39	52.08	2,970	146,688.30	154,677.60	-

688218	江苏北人	2019-11-29	2020-06-11	新发流通受限	17.36	23.48	5,790	100,514.40	135,949.20	-
688288	鸿泉物联	2019-10-29	2020-05-06	新发流通受限	24.99	28.45	3,429	85,690.71	97,555.05	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新发流通受限	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新发流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

**7.4.12.1.2 受限证券类别：债券**

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
128085	鸿达转债	2019-12-18	2020-01-08	新发流通受限	100.00	100.00	1,510	151,000.00	151,000.00	-
128086	国轩转债	2019-12-17	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	1,274	127,400.00	127,400.00	-
128084	木	2019-12-18	2020-01-10	新	100.00	100.00	1,190	119,000.00	119,000.00	-

	森转债			发流通受限						
110065	淮矿转债	2019-12-25	2020-01-13	新发流通受限	100.00	100.00	840	84,000.00	84,000.00	-
113554	仙鹤转债	2019-12-18	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	540	54,000.00	54,000.00	-
128088	深南转债	2019-12-24	2020-01-16	新发流通受限	100.00	100.00	336	33,600.00	33,600.00	-
110063	鹰19转债	2019-12-13	2020-01-03	新发流通受限	100.00	100.00	260	26,000.00	26,000.00	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019-12-31	重大事项	39.39	2020-01-02	40.43	20,218	551,792.14	796,387.02	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
2019121100000349	603288	海天味业	2019-12-11	2020-01-08	107.51	12,000.00	1,290,120.00
2019120600000166	300059	东方财富	2019-12-06	2020-01-03	15.77	35,000.00	551,950.00
2019121800000540	600703	三安光电	2019-12-18	2020-01-15	18.36	21,000.00	385,560.00
2019120600000220	601138	工业富联	2019-12-06	2020-01-03	18.27	21,000.00	383,670.00
2019120400000167	002475	立讯精密	2019-12-04	2020-01-02	36.50	10,000.00	365,000.00
2019121100000255	002600	领益智造	2019-12-11	2020-01-08	10.85	30,000.00	325,500.00
2019121100000221	002241	歌尔股份	2019-12-11	2020-01-08	19.92	15,000.00	298,800.00
2019121800000562	601990	南京证券	2019-12-18	2020-01-15	12.91	17,000.00	219,470.00
2019120600000138	002456	欧菲光	2019-12-06	2020-01-03	15.60	14,000.00	218,400.00
2019121100000171	000723	美锦	2019-12-11	2020-01-08	9.43	22,000.00	207,460.00



		能源					
2019120600000074	000961	中南建设	2019-12-06	2020-01-03	10.55	19,000.00	200,450.00
2019120600000149	002739	万达电影	2019-12-06	2020-01-03	18.15	11,000.00	199,650.00
2019121800000460	601872	招商轮船	2019-12-18	2020-01-15	8.26	22,000.00	181,720.00
2019120600000067	000671	阳光城	2019-12-06	2020-01-03	8.50	20,000.00	170,000.00
2019121100000246	002506	协鑫集成	2019-12-11	2020-01-08	5.91	27,000.00	159,570.00
2019120600000154	002797	第一创业	2019-12-06	2020-01-03	8.28	18,000.00	149,040.00
2019121100000345	600998	九州通	2019-12-11	2020-01-08	14.15	10,000.00	141,500.00
2019121800000472	600909	华安证券	2019-12-18	2020-01-15	7.30	19,000.00	138,700.00
2019121100000392	601099	太平洋	2019-12-11	2020-01-08	3.79	36,000.00	136,440.00
2019121800000467	600816	安信信托	2019-12-18	2020-01-15	4.44	29,000.00	128,760.00
2019121800000477	600516	方大炭素	2019-12-18	2020-01-02	12.16	10,000.00	121,600.00
2019121800000362	300296	利	2019-12-18	2020-01-15	7.67	13,000.00	99,710.00

		亚德					
2019121100000364	600567	山鹰纸业	2019-12-11	2020-01-08	3.77	24,000.00	90,480.00
2019121800000184	002217	合力泰	2019-12-18	2020-01-15	5.55	16,000.00	88,800.00
2019121100000346	601872	招商轮船	2019-12-11	2020-01-08	8.26	10,000.00	82,600.00
合计						481,000.00	6,334,950.00

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围內。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

##### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于指数成份股流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。

本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	542,979,713.90	97.63	523,502,843.90	97.34
交易性金融资产—债券投资	595,000.00	0.11	117,601.80	0.02
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
合计	543,574,713.90	97.74	523,620,445.70	97.36

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除 MSCI 中国 A 股国际通指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	+5%	27,571,441.77	25,921,243.32
	-5%	-27,571,441.77	-25,921,243.32

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (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。

##### (2) 各层次金融工具公允价值

截至 2019 年 12 月 31 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

541,361,638.35 元，第二层次的余额为 2,213,075.55 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 523,620,445.70 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。）

(3) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。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。

(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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	542,979,713.90	96.65
	其中：股票	542,979,713.90	96.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	595,000.00	0.11
	其中：债券	595,000.00	0.11
	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	15,518,644.76	2.76
8	其他各项资产	2,690,696.85	0.48
9	合计	561,784,055.51	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报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 6,334,950.00 元，占本基金期末资产净值的 1.14%。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,397,620.00	1.33
B	采矿业	15,585,843.39	2.80
C	制造业	252,887,638.93	45.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,797,542.92	2.66
E	建筑业	13,667,409.92	2.46
F	批发和零售业	9,259,183.82	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	16,000,325.78	2.88
H	住宿和餐饮业	740,160.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,647,246.33	4.25
J	金融业	141,975,317.66	25.53
K	房地产业	25,762,637.05	4.63
L	租赁和商务服务业	6,347,956.60	1.14
M	科学研究和技术服务业	3,505,381.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	703,006.64	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,268,022.82	0.95
R	文化、体育和娱乐业	4,588,077.04	0.82
S	综合	845,890.00	0.15
	合计	542,979,259.90	97.63

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	23,439	27,728,337.00	4.99
2	601318	中国平安	203,038	17,351,627.48	3.12
3	600036	招商银行	386,552	14,526,624.16	2.61
4	000858	五粮液	72,629	9,660,383.29	1.74
5	601166	兴业银行	389,316	7,708,456.80	1.39
6	600900	长江电力	412,189	7,576,033.82	1.36
7	600276	恒瑞医药	82,930	7,258,033.60	1.31
8	600000	浦发银行	549,948	6,802,856.76	1.22
9	601398	工商银行	1,003,800	5,902,344.00	1.06
10	000002	万科A	182,189	5,862,842.02	1.05

11	002415	海康威视	175,176	5,735,262.24	1.03
12	000001	平安银行	321,688	5,291,767.60	0.95
13	601288	农业银行	1,386,600	5,116,554.00	0.92
14	600030	中信证券	183,080	4,631,924.00	0.83
15	603288	海天味业	41,800	4,493,918.00	0.81
16	601601	中国太保	117,742	4,455,357.28	0.80
17	601668	中国建筑	786,527	4,420,281.74	0.79
18	300750	宁德时代	41,000	4,362,400.00	0.78
19	600016	民生银行	664,424	4,192,515.44	0.75
20	601328	交通银行	730,646	4,113,536.98	0.74
21	600585	海螺水泥	74,915	4,105,342.00	0.74
22	000333	美的集团	64,997	3,786,075.25	0.68
23	000651	格力电器	56,278	3,690,711.24	0.66
24	002475	立讯精密	100,304	3,661,096.00	0.66
25	600048	保利地产	222,960	3,607,492.80	0.65
26	600887	伊利股份	114,316	3,536,937.04	0.64
27	600104	上汽集团	146,062	3,483,578.70	0.63
28	600050	中国联通	581,567	3,425,429.63	0.62
29	300498	温氏股份	99,597	3,346,459.20	0.60
30	600309	万华化学	58,800	3,302,796.00	0.59
31	601818	光大银行	746,000	3,289,860.00	0.59
32	601888	中国国旅	36,636	3,258,772.20	0.59
33	601766	中国中车	455,830	3,254,626.20	0.59
34	002304	洋河股份	28,233	3,119,746.50	0.56
35	002142	宁波银行	105,390	2,966,728.50	0.53
36	001979	招商蛇口	148,181	2,944,356.47	0.53
37	002714	牧原股份	32,620	2,896,329.80	0.52
38	000725	京东方 A	634,550	2,880,857.00	0.52
39	601688	华泰证券	137,800	2,798,718.00	0.50
40	600031	三一重工	156,859	2,674,445.95	0.48
41	601211	国泰君安	140,800	2,603,392.00	0.47
42	603259	药明康德	27,500	2,533,300.00	0.46
43	601229	上海银行	266,261	2,526,816.89	0.45
44	600028	中国石化	477,500	2,440,025.00	0.44
45	601988	中国银行	658,100	2,428,389.00	0.44
46	000568	泸州老窖	27,426	2,377,285.68	0.43
47	600837	海通证券	151,536	2,342,746.56	0.42
48	300015	爱尔眼科	58,030	2,295,666.80	0.41
49	601006	大秦铁路	278,603	2,287,330.63	0.41
50	000063	中兴通讯	64,400	2,279,116.00	0.41
51	601169	北京银行	396,162	2,250,200.16	0.40
52	601989	中国重工	425,900	2,231,716.00	0.40
53	600690	海尔智家	114,368	2,230,176.00	0.40

54	601186	中国铁建	215,500	2,185,170.00	0.39
55	000166	申万宏源	422,241	2,161,873.92	0.39
56	000538	云南白药	23,877	2,135,320.11	0.38
57	601390	中国中铁	346,870	2,060,407.80	0.37
58	600019	宝钢股份	347,806	1,996,406.44	0.36
59	300059	东方财富	125,900	1,985,443.00	0.36
60	600999	招商证券	106,490	1,947,702.10	0.35
61	601336	新华保险	39,000	1,916,850.00	0.34
62	600015	华夏银行	240,248	1,842,702.16	0.33
63	600406	国电南瑞	86,491	1,831,879.38	0.33
64	601628	中国人寿	52,060	1,815,332.20	0.33
65	000338	潍柴动力	112,300	1,783,324.00	0.32
66	601857	中国石油	303,400	1,768,822.00	0.32
67	600346	恒力石化	109,940	1,767,835.20	0.32
68	002024	苏宁易购	174,500	1,764,195.00	0.32
69	002027	分众传媒	274,940	1,721,124.40	0.31
70	601899	紫金矿业	367,800	1,688,202.00	0.30
71	601012	隆基股份	67,940	1,686,950.20	0.30
72	000776	广发证券	110,900	1,682,353.00	0.30
73	601155	新城控股	42,200	1,633,984.00	0.29
74	002594	比亚迪	33,970	1,619,349.90	0.29
75	600340	华夏幸福	56,152	1,611,562.40	0.29
76	600547	山东黄金	48,731	1,589,605.22	0.29
77	601066	中信建投	51,900	1,577,760.00	0.28
78	000876	新希望	79,000	1,576,050.00	0.28
79	600919	江苏银行	216,300	1,566,012.00	0.28
80	600741	华域汽车	58,988	1,533,098.12	0.28
81	603501	韦尔股份	10,600	1,520,040.00	0.27
82	601088	中国神华	82,452	1,504,749.00	0.27
83	000895	双汇发展	51,550	1,496,496.50	0.27
84	600809	山西汾酒	16,353	1,466,864.10	0.26
85	603993	洛阳钼业	331,100	1,443,596.00	0.26
86	000661	长春高新	3,200	1,430,400.00	0.26
87	603160	汇顶科技	6,900	1,423,470.00	0.26
88	600009	上海机场	18,049	1,421,358.75	0.26
89	002230	科大讯飞	41,156	1,419,058.88	0.26
90	601225	陕西煤业	156,200	1,404,238.00	0.25
91	600703	三安光电	76,400	1,402,704.00	0.25
92	601009	南京银行	158,950	1,393,991.50	0.25
93	300760	迈瑞医疗	7,500	1,364,250.00	0.25
94	601138	工业富联	74,300	1,357,461.00	0.24
95	601933	永辉超市	179,300	1,351,922.00	0.24
96	688388	嘉元科技	24,307	1,334,454.30	0.24



97	601901	方正证券	153,200	1,328,244.00	0.24
98	600588	用友网络	46,585	1,323,014.00	0.24
99	601939	建设银行	178,547	1,290,894.81	0.23
100	600436	片仔癀	11,297	1,241,201.39	0.22
101	300122	智飞生物	24,900	1,236,534.00	0.22
102	600383	金地集团	83,974	1,217,623.00	0.22
103	601985	中国核电	243,000	1,215,000.00	0.22
104	002241	歌尔股份	60,820	1,211,534.40	0.22
105	603986	兆易创新	5,857	1,200,040.73	0.22
106	000069	华侨城 A	153,650	1,196,933.50	0.22
107	600958	东方证券	111,100	1,195,436.00	0.21
108	600570	恒生电子	15,003	1,166,183.19	0.21
109	600886	国投电力	126,376	1,160,131.68	0.21
110	002600	领益智造	106,900	1,159,865.00	0.21
111	600029	南方航空	161,100	1,156,698.00	0.21
112	000100	TCL 集团	254,000	1,135,380.00	0.20
113	002352	顺丰控股	30,300	1,126,857.00	0.20
114	600010	包钢股份	848,506	1,120,027.92	0.20
115	002236	大华股份	56,050	1,114,274.00	0.20
116	300003	乐普医疗	33,400	1,104,872.00	0.20
117	300033	同花顺	10,000	1,091,100.00	0.20
118	601877	正泰电器	40,220	1,077,896.00	0.19
119	002311	海大集团	29,600	1,065,600.00	0.19
120	002624	完美世界	24,100	1,063,774.00	0.19
121	002555	三七互娱	39,500	1,063,735.00	0.19
122	600606	绿地控股	152,000	1,056,400.00	0.19
123	300601	康泰生物	12,000	1,053,480.00	0.19
124	002044	美年健康	70,168	1,044,801.52	0.19
125	601669	中国电建	239,000	1,037,260.00	0.19
126	600115	东方航空	174,976	1,016,610.56	0.18
127	000938	紫光股份	31,868	1,007,028.80	0.18
128	600196	复星医药	37,621	1,000,718.60	0.18
129	600061	国投资本	65,700	994,698.00	0.18
130	002493	荣盛石化	78,550	973,234.50	0.17
131	300413	芒果超媒	27,730	969,440.80	0.17
132	002736	国信证券	76,795	963,777.25	0.17
133	601788	光大证券	73,100	957,610.00	0.17
134	600438	通威股份	72,700	954,551.00	0.17
135	300124	汇川技术	31,100	952,904.00	0.17
136	601872	招商轮船	113,700	939,162.00	0.17
137	601618	中国中冶	334,542	936,717.60	0.17
138	002001	新 和 成	40,200	935,052.00	0.17
139	300142	沃森生物	28,800	934,272.00	0.17

140	600332	白云山	26,137	930,738.57	0.17
141	002120	韵达股份	27,800	925,740.00	0.17
142	000596	古井贡酒	6,800	924,256.00	0.17
143	002007	华兰生物	26,200	920,930.00	0.17
144	600018	上港集团	158,300	913,391.00	0.16
145	300014	亿纬锂能	18,200	912,912.00	0.16
146	600893	航发动力	42,072	912,120.96	0.16
147	600660	福耀玻璃	37,600	902,024.00	0.16
148	002050	三花智控	51,858	898,699.14	0.16
149	600183	生益科技	42,600	891,192.00	0.16
150	601377	兴业证券	125,500	888,540.00	0.16
151	300347	泰格医药	14,050	887,257.50	0.16
152	600352	浙江龙盛	60,900	881,223.00	0.16
153	002916	深南电路	6,200	881,020.00	0.16
154	600926	杭州银行	96,120	880,459.20	0.16
155	601600	中国铝业	245,000	867,300.00	0.16
156	600795	国电电力	365,800	855,972.00	0.15
157	000066	中国长城	54,800	852,688.00	0.15
158	000768	中航飞机	51,960	851,104.80	0.15
159	300433	蓝思科技	61,300	847,166.00	0.15
160	603899	晨光文具	17,300	843,202.00	0.15
161	300144	宋城演艺	27,200	840,752.00	0.15
162	002466	天齐锂业	27,849	840,482.82	0.15
163	300136	信维通信	18,200	825,916.00	0.15
164	601100	恒立液压	16,500	820,875.00	0.15
165	600705	中航资本	168,136	815,459.60	0.15
166	600674	川投能源	82,564	813,255.40	0.15
167	600271	航天信息	34,900	808,633.00	0.15
168	000786	北新建材	31,700	806,765.00	0.15
169	000157	中联重科	120,200	802,936.00	0.14
170	000425	徐工机械	146,700	802,449.00	0.14
171	002146	荣盛发展	81,542	801,557.86	0.14
172	002371	北方华创	9,100	800,800.00	0.14
173	000963	华东医药	32,789	799,395.82	0.14
174	601990	南京证券	61,800	797,838.00	0.14
175	603799	华友钴业	20,218	796,387.02	0.14
176	002456	欧菲光	50,910	794,196.00	0.14
177	002032	苏泊尔	10,200	783,156.00	0.14
178	002202	金风科技	64,684	772,973.80	0.14
179	002179	中航光电	19,700	769,482.00	0.14
180	603369	今世缘	23,500	768,920.00	0.14
181	000656	金科股份	100,100	768,768.00	0.14
182	601108	财通证券	67,300	763,182.00	0.14

183	601727	上海电气	152,100	757,458.00	0.14
184	601021	春秋航空	17,156	752,976.84	0.14
185	002157	正邦科技	45,800	741,960.00	0.13
186	300450	先导智能	16,500	741,510.00	0.13
187	000783	长江证券	103,634	739,946.76	0.13
188	000703	恒逸石化	53,100	739,152.00	0.13
189	600111	北方稀土	68,127	738,496.68	0.13
190	002271	东方雨虹	27,900	734,049.00	0.13
191	000625	长安汽车	73,052	732,711.56	0.13
192	000860	顺鑫农业	13,900	732,252.00	0.13
193	000961	中南建设	69,400	732,170.00	0.13
194	300408	三环集团	32,720	729,001.60	0.13
195	000977	浪潮信息	24,100	725,410.00	0.13
196	000723	美锦能源	76,800	724,224.00	0.13
197	601111	中国国航	74,600	722,874.00	0.13
198	600085	同仁堂	25,637	722,450.66	0.13
199	002410	广联达	21,200	720,376.00	0.13
200	002463	沪电股份	32,300	717,383.00	0.13
201	600176	中国巨石	65,700	716,130.00	0.13
202	002460	赣锋锂业	20,550	715,756.50	0.13
203	300454	深信服	6,200	709,218.00	0.13
204	002739	万达电影	39,000	707,850.00	0.13
205	002384	东山精密	30,100	696,815.00	0.13
206	601198	东兴证券	51,700	679,338.00	0.12
207	600004	白云机场	38,700	675,315.00	0.12
208	300628	亿联网络	9,300	673,413.00	0.12
209	600801	华新水泥	25,400	671,322.00	0.12
210	002353	杰瑞股份	18,000	665,280.00	0.12
211	601607	上海医药	36,066	662,532.42	0.12
212	600600	青岛啤酒	12,986	662,286.00	0.12
213	600362	江西铜业	38,964	659,660.52	0.12
214	600536	中国软件	9,200	659,548.00	0.12
215	002180	纳思达	20,000	658,400.00	0.12
216	601998	中信银行	106,300	655,871.00	0.12
217	000627	天茂集团	92,600	651,904.00	0.12
218	002153	石基信息	16,637	648,843.00	0.12
219	300251	光线传媒	54,900	647,820.00	0.12
220	000671	阳光城	75,900	645,150.00	0.12
221	002673	西部证券	65,632	643,193.60	0.12
222	601919	中远海控	120,900	637,143.00	0.11
223	002422	科伦药业	26,944	632,914.56	0.11
224	002812	恩捷股份	12,500	631,250.00	0.11
225	000050	深天马 A	38,400	625,536.00	0.11

226	601018	宁波港	163,400	620,920.00	0.11
227	002129	中环股份	52,300	617,663.00	0.11
228	600516	方大炭素	50,752	617,144.32	0.11
229	603589	口子窖	11,200	614,992.00	0.11
230	601838	成都银行	67,700	614,039.00	0.11
231	600583	海油工程	82,918	611,934.84	0.11
232	600208	新湖中宝	161,200	609,336.00	0.11
233	600426	华鲁恒升	30,500	606,035.00	0.11
234	600763	通策医疗	5,900	604,927.00	0.11
235	600637	东方明珠	64,393	602,718.48	0.11
236	002065	东华软件	58,366	602,337.12	0.11
237	600498	烽火通信	21,900	601,155.00	0.11
238	002508	老板电器	17,780	601,141.80	0.11
239	603833	欧派家居	5,100	596,700.00	0.11
240	601117	中国化学	92,400	595,056.00	0.11
241	601360	三六零	25,300	594,803.00	0.11
242	002405	四维图新	36,800	592,480.00	0.11
243	600066	宇通客车	41,419	590,220.75	0.11
244	002601	龙蟠佰利	38,200	587,898.00	0.11
245	600170	上海建工	165,700	586,578.00	0.11
246	600872	中炬高新	14,900	586,315.00	0.11
247	000728	国元证券	63,100	584,937.00	0.11
248	603019	中科曙光	16,900	584,402.00	0.11
249	000999	华润三九	18,400	582,912.00	0.10
250	601992	金隅集团	156,202	582,633.46	0.10
251	600487	亨通光电	35,720	580,807.20	0.10
252	300383	光环新网	28,900	580,023.00	0.10
253	300308	中际旭创	11,100	578,865.00	0.10
254	600673	东阳光	56,500	578,560.00	0.10
255	600068	葛洲坝	86,376	576,991.68	0.10
256	601997	贵阳银行	60,320	576,659.20	0.10
257	601878	浙商证券	51,800	576,534.00	0.10
258	002049	紫光国微	11,300	574,492.00	0.10
259	002821	凯莱英	4,400	569,800.00	0.10
260	002439	启明星辰	16,800	567,840.00	0.10
261	300207	欣旺达	29,000	566,080.00	0.10
262	002506	协鑫集成	95,300	563,223.00	0.10
263	601555	东吴证券	56,253	561,967.47	0.10
264	300529	健帆生物	7,700	553,168.00	0.10
265	600760	中航沈飞	17,400	549,840.00	0.10
266	600369	西南证券	105,800	549,102.00	0.10
267	600489	中金黄金	64,748	549,063.04	0.10
268	600161	天坛生物	19,600	547,624.00	0.10

269	002797	第一创业	65,700	543,996.00	0.10
270	002926	华西证券	49,200	541,692.00	0.10
271	600642	申能股份	92,070	534,926.70	0.10
272	600109	国金证券	56,600	526,380.00	0.09
273	600038	中直股份	11,000	524,810.00	0.09
274	601238	广汽集团	44,580	521,140.20	0.09
275	601231	环旭电子	27,100	521,133.00	0.09
276	601233	桐昆股份	34,700	520,153.00	0.09
277	600845	宝信软件	15,800	519,820.00	0.09
278	601966	玲珑轮胎	22,500	515,925.00	0.09
279	000709	河钢股份	198,923	513,221.34	0.09
280	603939	益丰药房	7,000	512,540.00	0.09
281	300676	华大基因	7,400	508,380.00	0.09
282	000975	银泰黄金	37,100	504,931.00	0.09
283	002773	康弘药业	13,600	502,792.00	0.09
284	002127	南极电商	46,000	501,860.00	0.09
285	603517	绝味食品	10,800	501,660.00	0.09
286	002373	千方科技	27,800	501,512.00	0.09
287	600219	南山铝业	223,800	501,312.00	0.09
288	600011	华能国际	89,300	498,294.00	0.09
289	600297	广汇汽车	152,830	498,225.80	0.09
290	600704	物产中大	94,900	498,225.00	0.09
291	600998	九州通	35,200	498,080.00	0.09
292	600909	华安证券	67,900	495,670.00	0.09
293	601216	君正集团	158,000	494,540.00	0.09
294	002690	美亚光电	12,600	492,660.00	0.09
295	603658	安图生物	5,100	491,538.00	0.09
296	600188	兖州煤业	46,200	487,872.00	0.09
297	300558	贝达药业	7,400	486,180.00	0.09
298	601099	太平洋	127,800	484,362.00	0.09
299	600867	通化东宝	38,176	482,926.40	0.09
300	300146	汤臣倍健	29,600	482,184.00	0.09
301	600885	宏发股份	13,900	478,855.00	0.09
302	600153	建发股份	53,235	478,582.65	0.09
303	600528	中铁工业	41,600	478,400.00	0.09
304	002078	太阳纸业	48,600	478,224.00	0.09
305	600522	中天科技	57,400	476,420.00	0.09
306	600655	豫园股份	60,629	475,331.36	0.09
307	600118	中国卫星	22,227	474,990.99	0.09
308	601799	星宇股份	5,000	474,900.00	0.09
309	600875	东方电气	51,600	474,204.00	0.09
310	600298	安琪酵母	15,400	472,318.00	0.08
311	600779	水井坊	9,100	470,925.00	0.08

312	601800	中国交建	51,400	470,824.00	0.08
313	000629	攀钢钒钛	161,000	470,120.00	0.08
314	002013	中航机电	67,700	469,838.00	0.08
315	601128	常熟银行	51,400	468,254.00	0.08
316	600132	重庆啤酒	9,000	467,640.00	0.08
317	002465	海格通信	43,148	467,292.84	0.08
318	002299	圣农发展	19,400	467,152.00	0.08
319	600027	华电国际	127,200	466,824.00	0.08
320	603707	健友股份	11,200	464,576.00	0.08
321	300012	华测检测	31,100	463,701.00	0.08
322	603885	吉祥航空	30,700	460,500.00	0.08
323	000630	铜陵有色	197,190	459,452.70	0.08
324	600089	特变电工	69,010	458,916.50	0.08
325	603338	浙江鼎力	6,400	457,600.00	0.08
326	300253	卫宁健康	30,400	455,392.00	0.08
327	002558	巨人网络	25,200	455,112.00	0.08
328	600816	安信信托	102,362	454,487.28	0.08
329	000402	金融街	55,900	453,908.00	0.08
330	300070	碧水源	59,300	450,680.00	0.08
331	600895	张江高科	29,000	443,990.00	0.08
332	600977	中国电影	29,100	442,902.00	0.08
333	600688	上海石化	114,400	442,728.00	0.08
334	002081	金螳螂	50,155	442,367.10	0.08
335	603858	步长制药	21,444	442,175.28	0.08
336	000415	渤海租赁	115,900	440,420.00	0.08
337	000031	大悦城	61,300	440,134.00	0.08
338	002500	山西证券	53,000	439,370.00	0.08
339	000825	太钢不锈	106,800	436,812.00	0.08
340	300699	光威复材	9,600	436,800.00	0.08
341	600699	均胜电子	24,400	436,760.00	0.08
342	600535	天士力	28,276	436,015.92	0.08
343	600739	辽宁成大	28,599	435,562.77	0.08
344	603882	金域医学	8,500	435,370.00	0.08
345	300017	网宿科技	45,600	434,568.00	0.08
346	002152	广电运通	45,100	433,411.00	0.08
347	603866	桃李面包	10,200	432,888.00	0.08
348	000423	东阿阿胶	12,234	432,716.58	0.08
349	002110	三钢闽光	45,900	429,624.00	0.08
350	000401	冀东水泥	25,200	428,652.00	0.08
351	300357	我武生物	9,700	428,255.00	0.08
352	600521	华海药业	24,700	426,322.00	0.08
353	002010	传化智联	61,000	425,780.00	0.08
354	600398	海澜之家	55,300	424,704.00	0.08

355	000750	国海证券	79,000	421,860.00	0.08
356	600256	广汇能源	127,300	421,363.00	0.08
357	603444	吉比特	1,400	417,886.00	0.08
358	600466	蓝光发展	56,300	414,931.00	0.07
359	300285	国瓷材料	18,100	413,585.00	0.07
360	300024	机器人	29,200	408,800.00	0.07
361	000686	东北证券	43,800	407,340.00	0.07
362	002387	维信诺	25,600	407,040.00	0.07
363	601699	潞安环能	55,960	406,269.60	0.07
364	002268	卫士通	15,700	404,903.00	0.07
365	601958	金钼股份	50,394	403,655.94	0.07
366	601098	中南传媒	33,696	402,330.24	0.07
367	600201	生物股份	21,200	396,864.00	0.07
368	002385	大北农	79,477	395,795.46	0.07
369	002507	涪陵榨菜	14,800	395,604.00	0.07
370	600021	上海电力	49,100	395,255.00	0.07
371	600486	扬农化工	5,700	391,191.00	0.07
372	600372	中航电子	27,400	390,176.00	0.07
373	002174	游族网络	16,700	388,609.00	0.07
374	002372	伟星新材	29,500	388,515.00	0.07
375	000513	丽珠集团	11,500	387,550.00	0.07
376	600315	上海家化	12,500	386,750.00	0.07
377	600376	首开股份	48,400	385,748.00	0.07
378	600511	国药股份	14,100	384,789.00	0.07
379	601866	中远海发	148,500	384,615.00	0.07
380	000027	深圳能源	61,892	384,349.32	0.07
381	002223	鱼跃医疗	18,800	382,016.00	0.07
382	600733	北汽蓝谷	65,400	381,936.00	0.07
383	600258	首旅酒店	18,500	381,285.00	0.07
384	002399	海普瑞	19,500	380,445.00	0.07
385	600460	士兰微	24,500	379,015.00	0.07
386	002340	格林美	77,800	378,886.00	0.07
387	000932	华菱钢铁	79,000	377,620.00	0.07
388	002019	亿帆医药	23,200	377,000.00	0.07
389	600380	健康元	36,400	376,740.00	0.07
390	002281	光迅科技	12,600	375,228.00	0.07
391	000089	深圳机场	38,400	375,168.00	0.07
392	600160	巨化股份	51,500	374,920.00	0.07
393	600566	济川药业	15,300	369,954.00	0.07
394	002414	高德红外	17,600	369,600.00	0.07
395	300296	利亚德	47,700	365,859.00	0.07
396	000998	隆平高科	24,700	363,337.00	0.07
397	000623	吉林敖东	21,900	362,007.00	0.07

398	000983	西山煤电	58,975	361,516.75	0.07
399	600754	锦江酒店	12,500	358,875.00	0.06
400	002572	索菲亚	17,100	358,245.00	0.06
401	600820	隧道股份	58,900	355,756.00	0.06
402	300595	欧普康视	7,500	354,975.00	0.06
403	600675	中华企业	76,100	353,865.00	0.06
404	600373	中文传媒	25,800	351,138.00	0.06
405	601598	中国外运	82,100	349,746.00	0.06
406	002195	二三四五	108,135	349,276.05	0.06
407	000413	东旭光电	102,700	345,072.00	0.06
408	000729	燕京啤酒	52,900	344,908.00	0.06
409	600808	马钢股份	111,865	343,425.55	0.06
410	600549	厦门钨业	26,300	342,952.00	0.06
411	000883	湖北能源	81,300	339,021.00	0.06
412	600967	内蒙一机	31,700	336,971.00	0.06
413	000898	鞍钢股份	99,736	334,115.60	0.06
414	603883	老百姓	5,200	333,216.00	0.06
415	002563	森马服饰	33,700	332,619.00	0.06
416	600446	金证股份	16,100	331,338.00	0.06
417	000960	锡业股份	31,300	326,772.00	0.06
418	600026	中远海能	51,200	326,656.00	0.06
419	002294	信立泰	16,326	325,540.44	0.06
420	600598	北大荒	33,300	324,342.00	0.06
421	002217	合力泰	58,400	324,120.00	0.06
422	601333	广深铁路	105,900	324,054.00	0.06
423	600567	山鹰纸业	85,900	323,843.00	0.06
424	000028	国药一致	6,900	312,984.00	0.06
425	000778	新兴铸管	74,700	311,499.00	0.06
426	002074	国轩高科	21,400	311,370.00	0.06
427	000997	新大陆	19,600	311,248.00	0.06
428	600572	康恩贝	50,000	307,500.00	0.06
429	600782	新钢股份	59,700	306,261.00	0.06
430	600879	航天电子	51,000	304,980.00	0.05
431	600273	嘉化能源	26,800	301,500.00	0.05
432	600863	内蒙华电	108,800	299,200.00	0.05
433	000581	威孚高科	15,686	298,818.30	0.05
434	600392	盛和资源	32,900	298,403.00	0.05
435	000046	泛海控股	64,900	295,295.00	0.05
436	601880	大连港	145,000	294,350.00	0.05
437	600643	爱建集团	30,400	291,840.00	0.05
438	002583	海能达	34,500	290,145.00	0.05
439	601000	唐山港	111,100	288,860.00	0.05
440	000830	鲁西化工	27,400	287,974.00	0.05



441	000060	中金岭南	66,926	287,781.80	0.05
442	000732	泰禾集团	46,600	286,590.00	0.05
443	600282	南钢股份	83,000	286,350.00	0.05
444	002085	万丰奥威	40,900	286,300.00	0.05
445	002603	以岭药业	22,700	282,161.00	0.05
446	000738	航发控制	21,500	281,005.00	0.05
447	000039	中集集团	28,525	280,115.50	0.05
448	300072	三聚环保	44,000	278,080.00	0.05
449	000559	万向钱潮	51,696	277,607.52	0.05
450	002124	天邦股份	21,700	272,335.00	0.05
451	002092	中泰化学	40,100	272,279.00	0.05
452	600500	中化国际	50,600	268,180.00	0.05
453	688199	久日新材	4,494	268,112.04	0.05
454	600777	新潮能源	127,300	267,330.00	0.05
455	600056	中国医药	20,100	262,305.00	0.05
456	000839	中信国安	73,600	260,544.00	0.05
457	000598	兴蓉环境	56,000	259,280.00	0.05
458	600062	华润双鹤	19,600	255,780.00	0.05
459	600260	凯乐科技	18,800	255,116.00	0.05
460	002038	双鹭药业	19,300	253,795.00	0.05
461	600648	外高桥	14,600	253,602.00	0.05
462	600835	上海机电	15,100	250,207.00	0.04
463	600582	天地科技	77,500	247,225.00	0.04
464	000826	启迪环境	26,770	245,748.60	0.04
465	603077	和邦生物	165,600	245,088.00	0.04
466	002424	贵州百灵	26,400	229,944.00	0.04
467	000681	视觉中国	13,100	225,844.00	0.04
468	688358	祥生医疗	4,541	222,327.36	0.04
469	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.03
470	688369	致远互联	2,970	154,677.60	0.03
471	688218	江苏北人	5,790	135,949.20	0.02
472	688288	鸿泉物联	3,429	97,555.05	0.02
473	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
474	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
475	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
476	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

注：①报告期内“中信证券”系投资人申购交付组合证券被动持有。

②报告期内“中国银行”系投资人申购交付组合证券被动持有。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五 粮 液	18,056,784.55	3.36
2	300498	温氏股份	11,283,125.57	2.10
3	000002	万 科 A	10,542,326.56	1.96
4	002415	海康威视	10,067,348.92	1.87
5	000001	平安银行	9,079,555.28	1.69
6	000333	美的集团	6,293,403.34	1.17
7	000651	格力电器	6,229,335.25	1.16
8	300750	宁德时代	5,971,478.00	1.11
9	002304	洋河股份	5,639,359.48	1.05
10	300015	爱尔眼科	5,203,966.00	0.97
11	001979	招商蛇口	5,068,667.00	0.94
12	600519	贵州茅台	4,936,279.46	0.92
13	300059	东方财富	4,884,120.78	0.91
14	000725	京东方 A	4,870,949.00	0.91
15	002714	牧原股份	4,581,550.00	0.85
16	002142	宁波银行	4,574,232.47	0.85
17	600900	长江电力	4,332,700.00	0.81
18	002475	立讯精密	4,216,148.49	0.78
19	000166	申万宏源	4,023,370.00	0.75
20	002594	比亚迪	3,899,528.00	0.73

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五 粮 液	23,817,611.00	4.43
2	600519	贵州茅台	15,228,349.53	2.83
3	002415	海康威视	14,678,217.26	2.73
4	000002	万 科 A	14,536,513.17	2.70
5	000333	美的集团	13,796,155.41	2.57
6	000001	平安银行	12,533,138.82	2.33
7	601318	中国平安	9,651,544.00	1.79
8	000651	格力电器	8,590,802.69	1.60
9	002304	洋河股份	8,047,535.44	1.50
10	300498	温氏股份	7,389,053.14	1.37
11	000725	京东方 A	6,723,676.00	1.25
12	600036	招商银行	6,723,175.65	1.25
13	001979	招商蛇口	6,535,071.03	1.22
14	002714	牧原股份	6,109,011.30	1.14
15	002475	立讯精密	6,068,130.89	1.13

16	002142	宁波银行	5,994,883.72	1.11
17	002594	比亚迪	5,275,001.59	0.98
18	000063	中兴通讯	5,195,682.60	0.97
19	002024	苏宁易购	5,168,657.00	0.96
20	000568	泸州老窖	5,080,533.25	0.94

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	461,405,463.00
卖出股票收入（成交）总额	511,460,023.13

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	595,000.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	595,000.00	0.11

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128085	鸿达转债	1,510	151,000.00	0.03
2	128086	国轩转债	1,274	127,400.00	0.02
3	128084	木森转债	1,190	119,000.00	0.02
4	110065	淮矿转债	840	84,000.00	0.02
5	113554	仙鹤转债	540	54,000.00	0.01

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

#### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）（单位：手）	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2006	沪深 300 股指期货 IF2006 合约	6	7,409,520.00	132,540.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IF2003	沪深 300 股指期货 IF2003 合约	2	2,471,880.00	144,360.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2001	中证 500 股指期货 IC2001 合约	1	1,053,360.00	11,240.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2003	中证 500 股指期货 IC2003 合约	1	1,046,320.00	8,360.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计				296,500.00	
股指期货投资本期收益				3,148,951.45	
股指期货投资本期公允价值变动				879,820.00	

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，浦发银行系标的指数成份股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.13.2 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。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,311,483.80
2	应收证券清算款	1,368,255.59
3	应收股利	-
4	应收利息	10,957.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,690,696.85

8.13.4 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。

8.13.5 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。

8.13.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,599	79,053.71	67,024,556.00	15.14%	178,289,596.00	40.28%	197,307,581.00	44.58%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	生命保险资管—招商银行—生命保险资产管理有限公司富盈 5 号	11,000,000.00	2.51%
2	华夏基金华兴 5 号股票型养老金产品—中国建设银行股份有限公司	9,515,400.00	2.17%
3	联讯证券股份有限公司	7,324,237.00	1.67%
4	厦门市融资担保有限公司	5,500,000.00	1.26%
4	生命保险资管—农业银行—生命资产富盈 1 号资产管理产品	5,500,000.00	1.26%
6	安英慧	5,038,800.00	1.15%
7	招商证券股份有限公司	4,874,858.00	1.11%
8	生命保险资管—农业银行—生命资产价值精选资产管理产品	2,900,000.00	0.66%
9	华泰证券股份有限公司	2,427,100.00	0.55%
10	中国银河证券股份有限公司	2,039,005.00	0.47%
11	中国银行股份有限公司—MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金	197,307,581.00	45.10%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金

0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年9月17日)基金份额总额	602,503,247.00
本报告期期初基金份额总额	602,503,247.00
本报告期基金总申购份额	659,706,315.00
减：本报告期基金总赎回份额	819,587,829.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	442,621,733.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，周璇女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 70,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 5 年的审计服务。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	4	467,550,640.29	48.84%	201,657.36	57.42%	-
方正证券	4	175,082,144.35	18.29%	75,511.01	21.50%	-
中信证券	9	101,337,027.15	10.58%	43,707.99	12.44%	-
中国银河证券	5	168,810,298.25	17.63%	23,411.42	6.67%	-
国泰君安证券	4	41,018,968.51	4.28%	5,385.21	1.53%	-
中金公司	4	3,597,472.31	0.38%	1,551.60	0.44%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了东北证券、东方证券、东吴证券、高华证券、国盛证券、国信证券、海通证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、申万宏源证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、西部证券、西藏东方财富证券、兴业证券、招商证券、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，中信证券的部分交易单元、华泰证券的部分交易单元、方正证券的部分交易单元、中金公司的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券



商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
华泰证券	837,666.30	19.28%	-	-
方正证券	304,753.70	7.02%	-	-
中信证券	-	-	-	-
中国银河证券	2,462,210.12	56.68%	-	-
国泰君安证券	739,377.50	17.02%	-	-
中金公司	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 所持停牌股票“信威集团”估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-01
2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-02
3	华夏基金管理有限公司关于华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-08
4	华夏基金管理有限公司关于提示投资者在中国结算办理场内外账户对应关系维护业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-24
6	华夏基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善客户身份信息资料的特别提示公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-04
7	华夏基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在首批科创板股票上市首日的风险提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-07-17
8	华夏基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在首批科创板股票上市首日的风险提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-07-22
9	华夏基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-07-22
10	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下基金	中国证监会指定报刊及网站	2019-10-21

	基金合同的公告		
11	华夏基金管理有限公司关于调整华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-11-28
12	华夏基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-12-10

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	1	2019-01-01 至 2019-12-31	166,957,581.00	85,400,000.00	55,050,000.00	197,307,581.00	44.58%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会准予基金转型的文件；

13.1.2 《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

13.1.3 《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

13.1.4 法律意见书；

13.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

13.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 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。

13.3 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

二〇二〇年四月九日