

**华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式  
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 7 月 16 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.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	8
§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.....	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
8.12 投资组合报告附注.....	49
§9 基金份额持有人信息.....	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
9.3 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.....	50
§10 开放式基金份额变动.....	51
§11 重大事件揭示.....	51
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§13 备查文件目录.....	53

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金	
基金简称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数	
基金主代码	007505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 7 月 16 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	
报告期末基金份额总额	90,830,786.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
下属分级基金的交易代码	007505	007506
报告期末下属分级基金的份额总额	38,205,250.34 份	52,625,536.43 份

### 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。
投资策略	本基金主要采用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	中证华夏 AH 经济蓝筹股票指数收益率×95%+中国人民银行公布的人民币活期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于中高风险品种。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	95599
传真	010-63136700	010-68121816
注册地址	北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	杨明辉	周慕冰

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	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 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日	
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
本期已实现收益	203,493.96	217,865.27
本期利润	1,929,255.74	2,514,235.26
加权平均基金份额本期利润	0.0446	0.0355
本期加权平均净值利润率	4.53%	3.61%
本期基金份额净值增长率	5.06%	4.92%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
期末可供分配利润	188,738.18	188,167.97
期末可供分配基金份额利润	0.0049	0.0036
期末基金资产净值	40,139,846.10	55,214,116.76
期末基金份额净值	1.0506	1.0492
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
基金份额累计净值增长率	5.06%	4.92%

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。

④本基金合同于 2019 年 7 月 16 日生效。

### 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

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.65%	0.69%	8.51%	0.68%	0.14%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.06%	0.76%	4.56%	0.76%	0.50%	0.00%

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.57%	0.69%	8.51%	0.68%	0.06%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.92%	0.76%	4.56%	0.76%	0.36%	0.00%

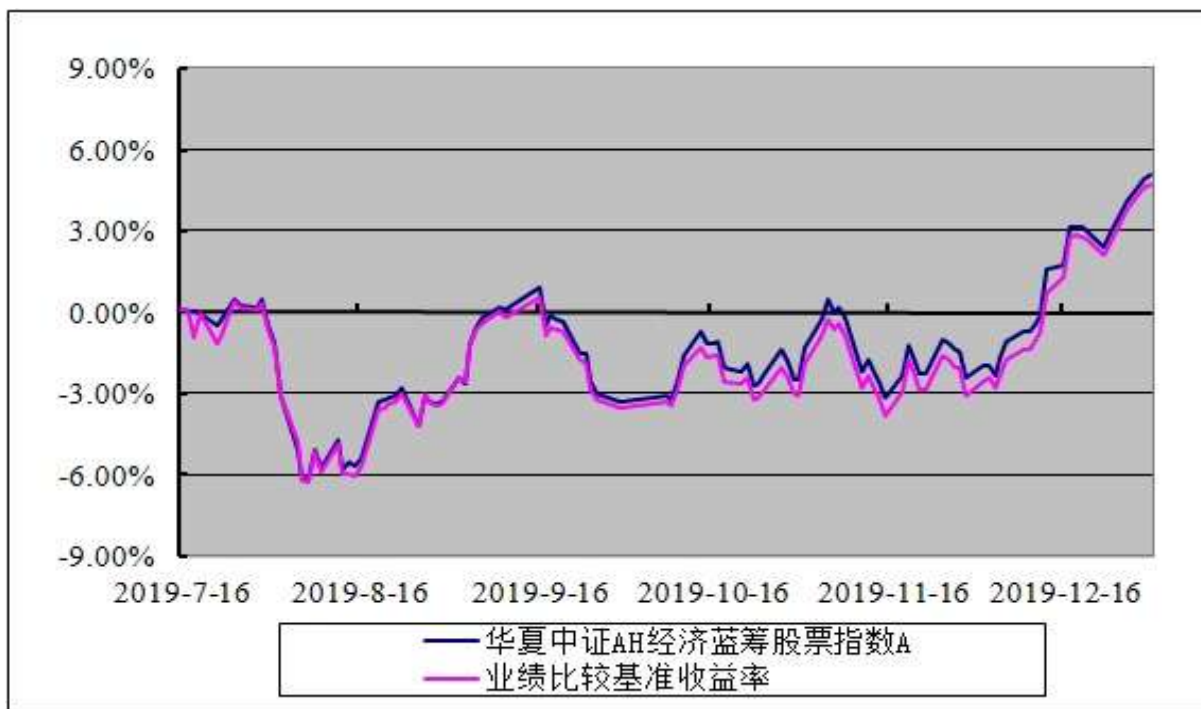
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

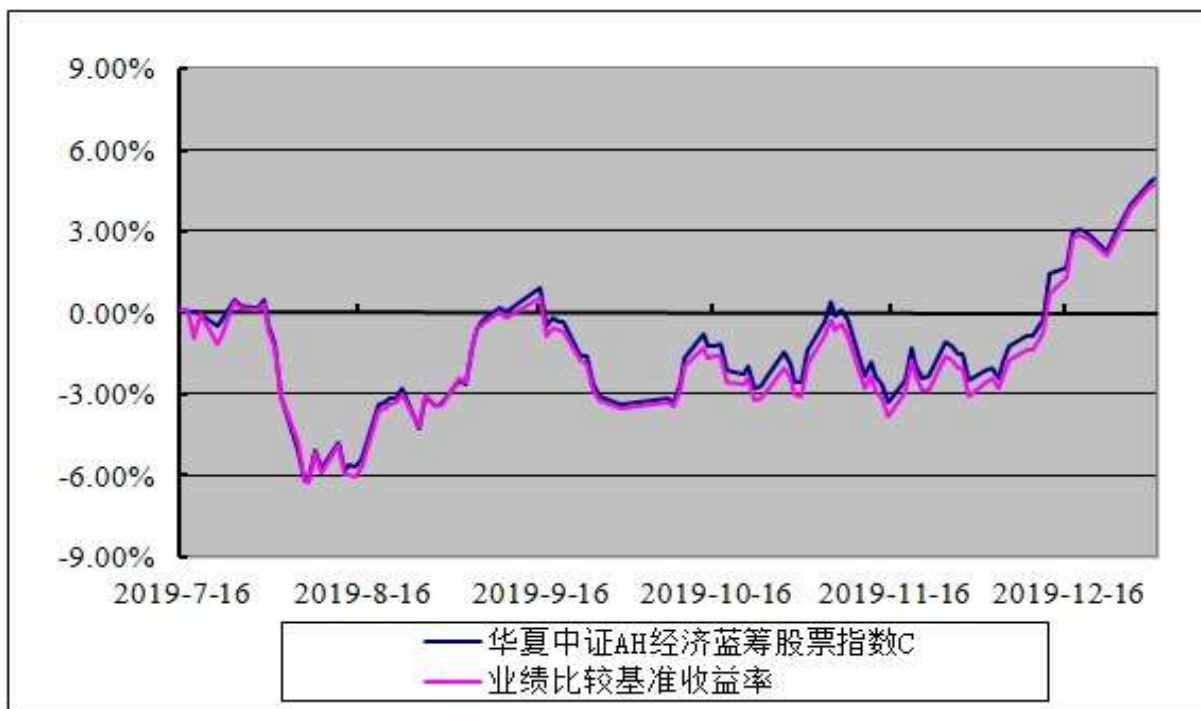
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 7 月 16 日至 2019 年 12 月 31 日)

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A



华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C



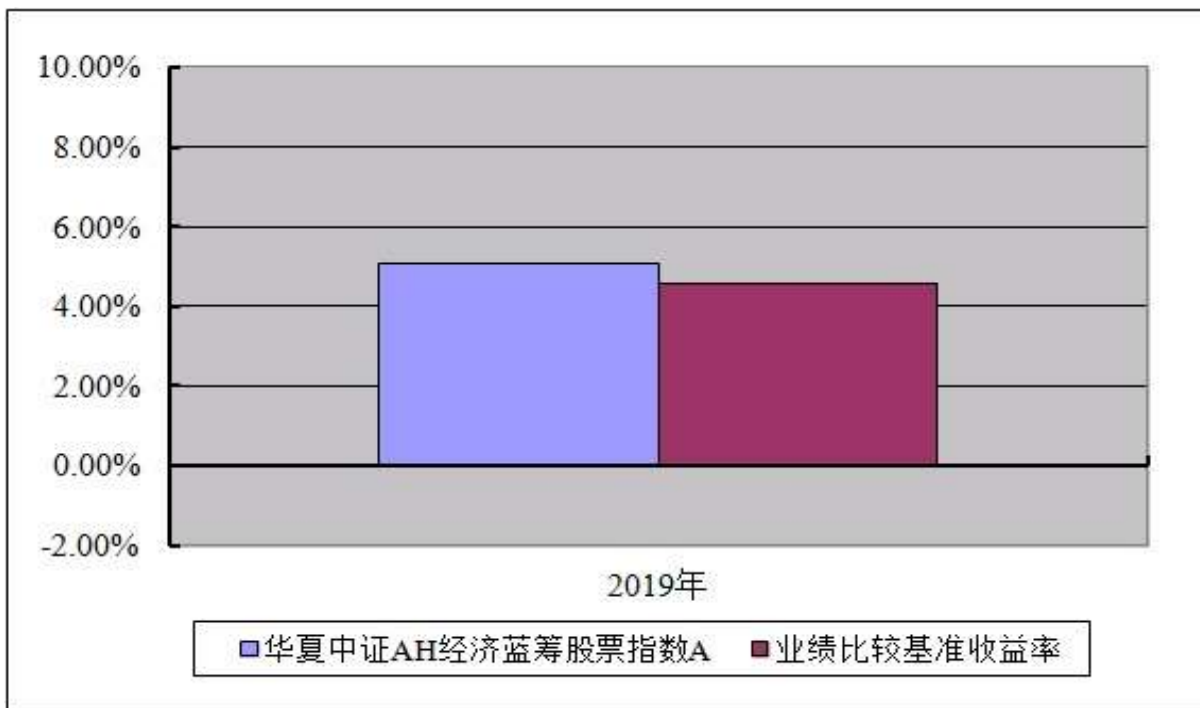
注：①本基金合同于 2019 年 7 月 16 日生效。

②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。

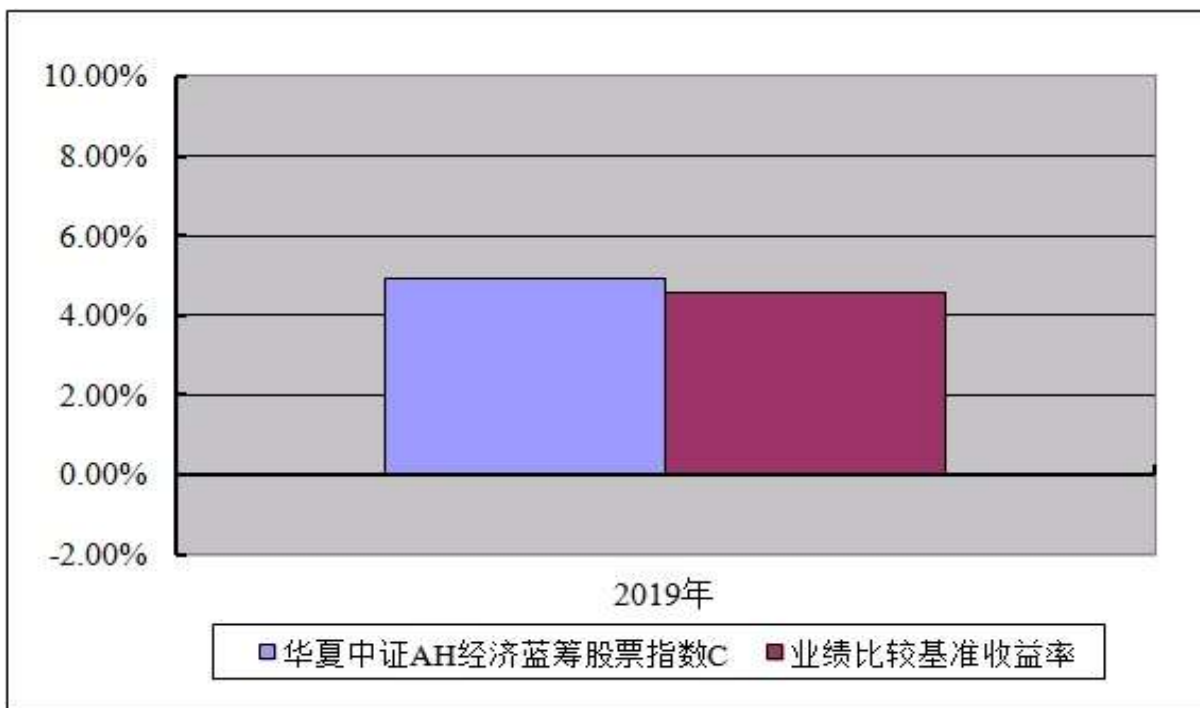
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金  
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

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A



华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C



注：本基金合同于 2019 年 7 月 16 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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。



## §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		
庞亚平	本基金的基金经理、数量投资部总监	2019-07-16	-	10 年	统计学硕士，CFA。曾任中证指数有限公司研究部研究员、市场部主管。2016 年 1 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员、投资经理等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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华夏中证 AH 经济蓝筹指数，中证华夏 AH 经济蓝筹股票指数从沪深 A 股以及符合港股通资格的港股中分行业选取一定数量财务基本面良好的蓝筹股票作为指数成份股，行业权重根据各行业对国民经济的贡献度进行分配，行业内个股根据财务基本面综合得分加权，以综合反映国民经济产业结构变迁及发展趋势。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，全球经济仍处于逐步探底阶段，美国制造业产出和商业投资因受到全球经济走弱及贸易摩擦拖累表现偏弱，而消费和地产持续坚挺；欧元区和日本制造业依然疲软但有企稳迹象。尽管国际宏观经济较弱，美欧和新兴市场从年初起相继降息的效应逐渐显现，全球流动性显著好转，加

之年末随着中美就贸易协议达成阶段性一致，贸易不确定性也有所缓和，推动风险资产价格普涨。国内方面，在内外需不足、去杠杆和中美贸易摩擦多重影响下，国内经济增速持续放缓。四季度以来，受国家逆周期政策不断推进和外围风险缓释的催化，终端需求缓中趋稳，库存周期逐步接近尾声，年末工业生产有所改善。2019 年，人民币汇率继续宽幅震荡，年中曾因中美贸易关系恶化和香港事件走弱，但外汇市场整体情绪较稳定，人民币汇率在年末再度走强。

市场方面，A 股在年初和年末表现强势。2019 年 1 季度国内经济形势好于预期推动核心资产价格上涨；2、3 季度中美贸易关系恶化，但市场仍有结构性机会；4 季度，国家逆周期政策推进和外部环境好转使得国内经济走势趋稳，市场再度走强。2019 年恒指跑输全球各大指数，市场行业和主题相对单一以及年中发生的香港社会事件使得资金外流，影响恒指整体涨幅，港股内部亦有所分化，港股涨幅靠前行业与 A 股重合度高，相关热点风格主题、市场估值逐步贴近 A 股特征，结构性特征明显。

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、赎回等工作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 基金份额净值为 1.0506 元，本报告期份额净值增长率为 5.06%；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 基金份额净值为 1.0492 元，本报告期份额净值增长率为 4.92%，同期业绩比较基准增长率为 4.56%。

#### 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，国家宏观经济承受较大压力，但基本面韧性仍存。新冠疫情爆发对经济造成了深而短的冲击，随着国内疫情得到控制，我们预计各项宏观数据将在二季度触底回升。库存周期处于磨底阶段，当前 PPI 同比收缩趋势尚未结束，反映企业利润增长受限；地产投资承受政策压力，边际增长乏力。库存扩张尚未有需求端的强劲支持。从外部看，逆全球化的趋势仍在延续，中美贸易依然存在反复可能，全球疫情蔓延增加了不确定性，各国或寻求大规模财政宽松。对此情形，国家货币政策在保持独立性的前提下重点将是疏通货币传导机制和降成本，财政政策主抓扩基建的同时会更加注重和货币政策的协同，逆周期调节政策主要着力于扩大内需。

对于证券市场，宽松的流动性环境对股市较为友好，宏观经济的修复和产业结构的调整升级或会使得市场结构性机会多于整体性机会。港股市场在 2019 年走势较弱，加之 2020 年初新冠病毒疫情的冲击，H 股估值已接近历史最低位水平，伴随疫情冲击后中国宏观经济基本面修复、香港事件常态化和相对宽松的货币环境，以及南下资金定价权的增强，符合港股通资格的港股在 2020 年估值有望得到提升。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## §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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2019 年 7 月 16 日至 2019 年 12 月 31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为,华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为,华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第 21377 号

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式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

我们审计了华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金(以下简称“华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年 7 月 16 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间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,公允反映了华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数

基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间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，我们独立于华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数基金，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

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数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中证 AH 经济蓝筹股票指数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中证 AH 经济蓝筹股票指数基金、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中证 AH 经济蓝筹股票指数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，就可能导致对华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数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中证 AH 经济蓝筹股票指数基金不能持续经营。

(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：华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	5,240,822.05
结算备付金		-
存出保证金		82,588.85
交易性金融资产	7.4.7.2	90,988,004.41
其中：股票投资		90,984,190.65
基金投资		-
债券投资		3,813.76
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		137,358.66
应收利息	7.4.7.5	1,986.02
应收股利		11,311.72
应收申购款		384,065.63
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		96,846,137.34
<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>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		186.82
应付赎回款		1,290,304.76
应付管理人报酬		41,733.77
应付托管费		8,346.76
应付销售服务费		14,783.11
应付交易费用	7.4.7.7	16,804.54
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	120,014.72
负债合计		1,492,174.48
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	90,830,786.77
未分配利润	7.4.7.10	4,523,176.09
所有者权益合计		95,353,962.86
负债和所有者权益总计		96,846,137.34

注：①报告截止日 2019 年 12 月 31 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 基金份额净值 1.0506 元，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 基金份额净值 1.0492 元；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数基金份额总额 90,830,786.77 份（其中 A 类 38,205,250.34 份，C 类 52,625,536.43 份）。

②本基金合同于 2019 年 7 月 16 日生效，本报告期自 2019 年 7 月 16 日至 2019 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年7月16日（基金合同生效日）至2019 年12月31日
<b>一、收入</b>		5,161,860.09
1.利息收入		49,459.79
其中：存款利息收入	7.4.7.11	49,459.17
债券利息收入		0.62
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,072,793.17
其中：股票投资收益	7.4.7.12	527,249.14
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
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	-
股利收益	7.4.7.17	545,544.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	4,022,131.77
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	17,475.36
<b>减：二、费用</b>		718,369.09
1.管理人报酬		257,899.63
2.托管费		51,579.92
3.销售服务费		95,975.75
4.交易费用	7.4.7.20	179,301.34
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		-
7.其他费用	7.4.7.21	133,612.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,443,491.00
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,443,491.00

注：本基金合同于 2019 年 7 月 16 日生效，本报告期自 2019 年 7 月 16 日至 2019 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 7 月 16 日（基金合同生效日）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）	124,384,327.63	-	124,384,327.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,443,491.00	4,443,491.00
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）	-33,553,540.86	79,685.09	-33,473,855.77
其中：1.基金申购款	28,624,106.14	-649,190.12	27,974,916.02
2.基金赎回款	-62,177,647.00	728,875.21	-61,448,771.79
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）	90,830,786.77	4,523,176.09	95,353,962.86

注：本基金合同于 2019 年 7 月 16 日生效，本报告期自 2019 年 7 月 16 日至 2019 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

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金（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[2019]938 号《关于准予华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金注册的批复》，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》、《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式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。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2019 年 6 月 3 日至 2019 年 7 月 12 日共募集 124,317,926.68 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2019）验字第 60739337\_A55 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 7 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 124,384,327.63 份基金份额，其中认购资金利息折合 66,400.95 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本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、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券以及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权、货币市场工具（含同业存单）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。

#### 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。本会计报表的实际编制期间为 2019 年 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日。

##### 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。

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

同一类别内的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 7.4.4.14 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》，根据具体情况参考《关

于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

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。

4、本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致本基金在正常的经营活动中，部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时，本基金需要作出相关会计估计。

#### 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	
	活期存款	5,240,822.05
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	5,240,822.05	

##### 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	86,962,672.64	90,984,190.65	4,021,518.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,200.00	3,813.76
	银行间市场	-	-
	合计	3,200.00	3,813.76
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	86,965,872.64	90,988,004.41	4,022,131.77

##### 7.4.7.3 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	应收活期存款利息	1,606.27
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	368.13
应收债券利息	0.62
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	-
其他	11.00
合计	1,986.02

#### 7.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	16,804.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	16,804.54

#### 7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14.72
预提费用	110,000.00
应付指数使用费	10,000.00
合计	120,014.72

#### 7.4.7.6 实收基金

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	44,993,831.21	44,993,831.21
本期申购	6,919,012.96	6,919,012.96
本期赎回（以“-”号填列）	-13,707,593.83	-13,707,593.83
本期末	38,205,250.34	38,205,250.34

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	79,390,496.42	79,390,496.42
本期申购	21,705,093.18	21,705,093.18
本期赎回（以“-”号填列）	-48,470,053.17	-48,470,053.17
本期末	52,625,536.43	52,625,536.43

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 124,317,926.68 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 66,400.95 元在本基金合同生效后，折算为 66,400.95 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.7 未分配利润

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	203,493.96	1,725,761.78	1,929,255.74
本期基金份额交易产生的变动数	-14,755.78	20,095.80	5,340.02
其中：基金申购款	7,485.73	-142,647.94	-135,162.21
基金赎回款	-22,241.51	162,743.74	140,502.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	188,738.18	1,745,857.58	1,934,595.76

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	217,865.27	2,296,369.99	2,514,235.26
本期基金份额交易产生的变动数	-29,697.30	104,042.37	74,345.07
其中：基金申购款	8,539.44	-522,567.35	-514,027.91
基金赎回款	-38,236.74	626,609.72	588,372.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	188,167.97	2,400,412.36	2,588,580.33

#### 7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	43,432.40
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	5,660.65

其他	366.12
合计	49,459.17

#### 7.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	45,234,864.33
减：卖出股票成本总额	44,707,615.19
买卖股票差价收入	527,249.14

#### 7.4.7.10 债券投资收益

无。

#### 7.4.7.11 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

##### 7.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.12.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	545,544.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	545,544.03

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1.交易性金融资产	4,022,131.77
——股票投资	4,021,518.01
——债券投资	613.76
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	4,022,131.77

## 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	17,475.36
合计	17,475.36

## 7.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	179,301.34
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	179,301.34

## 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	60,000.00
银行费用	5,242.88
银行间账户维护费	-
指数使用费	18,369.57
其他	-
合计	133,612.45

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司

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。

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7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	19,204,479.17	10.88%

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7月16日（基金合同生效日）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	8,279.23	17.16%	-	-
------	----------	--------	---	---

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7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	257,899.63
其中：支付销售机构的客户维护费	72,859.97

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 2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	51,579.92

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。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	2,956.61	2,956.61
中信证券	-	35.59	35.59



华夏财富	-	0.50	0.50
合计	-	2,992.70	2,992.70

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	华夏中证AH经济蓝筹股票指数A	华夏中证AH经济蓝筹股票指数C
基金合同生效日（2019年7月16日）持有的基金份额	10,002,444.69	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,002,444.69	-
期末持有的基金份额占基金总额比例	26.18%	-

注：本基金管理人于 2019 年 7 月 11 日认购本基金，认购费用为 1000.00 元。

##### 7.4.10.3.2 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

无。

##### 7.4.10.4 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7月16日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	5,240,822.05	43,432.40

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

##### 7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

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 209,990.00 元，占基金资产净值的比例为 0.22%；本基金(因指数成份股包括农业银行而被动)持有的农业银行股票估值总额为人民币 179,703.00 元，占基金资产净值的比例为 0.19%。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

本基金本报告期无利润分配事项。

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

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
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	-

#### 7.4.13 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之内。

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	-	-	-
交易性金融资产	-	32,529,861.04	32,529,861.04
衍生金融资产	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	-	-	-
应收股利	-	11,311.72	11,311.72
应收申购款	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产合计	-	32,541,172.76	32,541,172.76
以外币计价的负债			
应付在途资金	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-
应付换汇款	-	-	-
应付赎回款	-	-	-
应付赎回费	-	-	-
负债合计	-	-	-

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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
	港币相对人民币升值 5%	1,627,058.64
港币相对人民币贬值 5%	-1,627,058.64	

##### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	90,984,190.65	95.42
交易性金融资产—债券投资	3,813.76	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
合计	90,988,004.41	95.42

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	除中证华夏 AH 经济蓝筹股票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
	+5%	4,969,966.29
	-5%	-4,969,966.29

#### 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 90,988,004.41 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	90,984,190.65	93.95
	其中:股票	90,984,190.65	93.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,813.76	0.00
	其中:债券	3,813.76	0.00
	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	5,240,822.05	5.41
8	其他各项资产	617,310.88	0.64
9	合计	96,846,137.34	100.00

注:本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 32,529,861.04 元,占基金资产净值比例为 34.11%。

### 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	668,640.00	0.70
B	采矿业	2,572,995.60	2.70
C	制造业	22,988,318.97	24.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,283,958.00	1.35
E	建筑业	4,879,858.00	5.12
F	批发和零售业	10,069,449.00	10.56
G	交通运输、仓储和邮政业	2,873,560.00	3.01
H	住宿和餐饮业	657,648.00	0.69
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,057,242.00	2.16
J	金融业	5,334,262.00	5.59
K	房地产业	2,550,609.00	2.67
L	租赁和商务服务业	1,701,791.00	1.78
M	科学研究和技术服务业	46,060.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	47,472.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	715,888.00	0.75
S	综合	-	-
	合计	58,454,329.61	61.30

## 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.2.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	12,694,788.13	13.31
必需消费品	3,871,086.39	4.06
房地产	3,850,331.18	4.04
材料	2,678,573.90	2.81
非必需消费品	2,043,258.06	2.14
工业	1,950,274.30	2.05
保健	1,712,977.70	1.80
信息技术	1,330,624.76	1.40
金融	944,234.53	0.99
公用事业	919,683.89	0.96
能源	534,028.20	0.56
合计	32,529,861.04	34.11

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	00700	腾讯控股	33,700	11,338,532.42	11.89

2	03323	中国建材	238,000	1,854,802.07	1.95
3	600887	伊利股份	47,900	1,482,026.00	1.55
4	000002	万科 A	44,200	1,422,356.00	1.49
5	600519	贵州茅台	1,200	1,419,600.00	1.49
6	01918	融创中国	32,000	1,334,353.89	1.40
7	601668	中国建筑	210,100	1,180,762.00	1.24
8	600655	豫园股份	148,700	1,165,808.00	1.22
9	601939	建设银行	159,000	1,149,570.00	1.21
10	000501	鄂武商 A	85,300	1,132,784.00	1.19
11	00267	中信股份	111,000	1,036,077.06	1.09
12	600859	王府井	72,100	1,008,679.00	1.06
13	601318	中国平安	11,600	991,336.00	1.04
14	000338	潍柴动力	58,500	928,980.00	0.97
15	600028	中国石化	179,700	918,267.00	0.96
16	01099	国药控股	36,000	917,457.88	0.96
17	00941	中国移动	15,500	909,440.65	0.95
18	002251	步步高	97,600	888,160.00	0.93
19	000564	供销大集	370,000	884,300.00	0.93
20	600729	重庆百货	29,500	880,575.00	0.92
21	000858	五粮液	6,600	877,866.00	0.92
22	601186	中国铁建	85,100	862,914.00	0.90
23	601390	中国中铁	143,400	851,796.00	0.89
24	02319	蒙牛乳业	30,000	846,512.10	0.89
25	02007	碧桂园	75,000	838,450.08	0.88
26	000651	格力电器	12,500	819,750.00	0.86
27	000333	美的集团	14,000	815,500.00	0.86
28	06808	高鑫零售	93,500	791,488.81	0.83
29	600050	中国联通	132,600	781,014.00	0.82
30	000829	天音控股	123,800	776,226.00	0.81
31	600585	海螺水泥	13,400	734,320.00	0.77
32	00606	中国粮油控股	192,000	710,317.71	0.74
33	002419	天虹股份	66,500	701,575.00	0.74
34	00881	中升控股	23,500	671,521.48	0.70
35	300226	上海钢联	8,600	669,080.00	0.70
36	300498	温氏股份	19,900	668,640.00	0.70
37	00960	龙湖集团	19,000	621,223.43	0.65
38	600019	宝钢股份	108,000	619,920.00	0.65
39	00322	康师傅控股	48,000	571,865.95	0.60
40	601888	中国国旅	6,200	551,490.00	0.58
41	00883	中国海洋石油	46,000	534,028.20	0.56
42	000725	京东方 A	117,200	532,088.00	0.56
43	601899	紫金矿业	113,000	518,670.00	0.54
44	600029	南方航空	71,800	515,524.00	0.54
45	600104	上汽集团	21,400	510,390.00	0.54



46	600606	绿地控股	72,300	502,485.00	0.53
47	000100	TCL 集团	111,900	500,193.00	0.52
48	600690	海尔智家	25,600	499,200.00	0.52
49	601669	中国电建	113,900	494,326.00	0.52
50	01109	华润置地	14,000	486,587.70	0.51
51	601933	永辉超市	61,200	461,448.00	0.48
52	601766	中国中车	64,600	461,244.00	0.48
53	01816	中广核电力	245,000	456,489.49	0.48
54	00788	中国铁塔	290,000	446,815.06	0.47
55	601857	中国石油	76,500	445,995.00	0.47
56	01958	北京汽车	110,000	435,528.24	0.46
57	601618	中国中冶	150,600	421,680.00	0.44
58	601111	中国国航	43,300	419,577.00	0.44
59	600031	三一重工	24,400	416,020.00	0.44
60	002304	洋河股份	3,700	408,850.00	0.43
61	601328	交通银行	70,700	398,041.00	0.42
62	00291	华润啤酒	10,000	386,081.18	0.40
63	600546	山煤国际	55,000	383,900.00	0.40
64	600115	东方航空	65,000	377,650.00	0.40
65	600754	锦江酒店	13,000	373,230.00	0.39
66	601006	大秦铁路	44,700	366,987.00	0.38
67	000938	紫光股份	11,600	366,560.00	0.38
68	600048	保利地产	22,600	365,668.00	0.38
69	600153	建发股份	40,100	360,499.00	0.38
70	600362	江西铜业	20,800	352,144.00	0.37
71	000876	新希望	17,600	351,120.00	0.37
72	601600	中国铝业	98,600	349,044.00	0.37
73	601800	中国交建	37,900	347,164.00	0.36
74	600309	万华化学	5,900	331,403.00	0.35
75	00992	联想集团	70,000	327,945.06	0.34
76	600600	青岛啤酒	6,400	326,400.00	0.34
77	00688	中国海外发展	12,000	326,243.08	0.34
78	601088	中国神华	17,600	321,200.00	0.34
79	00151	中国旺旺	47,000	306,500.08	0.32
80	601166	兴业银行	15,200	300,960.00	0.32
81	02328	中国财险	34,000	285,986.72	0.30
82	600036	招商银行	7,600	285,608.00	0.30
83	600258	首旅酒店	13,800	284,418.00	0.30
84	600016	民生银行	44,600	281,426.00	0.30
85	601919	中远海控	50,000	263,500.00	0.28
86	000671	阳光城	30,600	260,100.00	0.27
87	600755	厦门国贸	35,200	258,368.00	0.27
88	600900	长江电力	14,000	257,320.00	0.27
89	601607	上海医药	13,700	251,669.00	0.26

90	002027	分众传媒	40,200	251,652.00	0.26
91	600704	物产中大	47,800	250,950.00	0.26
92	600057	厦门象屿	59,300	246,095.00	0.26
93	00175	吉利汽车	18,000	245,730.37	0.26
94	300750	宁德时代	2,300	244,720.00	0.26
95	00813	世茂房地产	9,000	243,473.00	0.26
96	000157	中联重科	36,300	242,484.00	0.25
97	01658	邮储银行	51,000	242,129.33	0.25
98	000415	渤海租赁	61,900	235,220.00	0.25
99	600170	上海建工	66,400	235,056.00	0.25
100	600068	葛洲坝	34,800	232,464.00	0.24
101	000895	双汇发展	7,800	226,434.00	0.24
102	600011	华能国际	40,500	225,990.00	0.24
103	600795	国电电力	96,400	225,576.00	0.24
104	600138	中青旅	17,800	224,280.00	0.24
105	600089	特变电工	33,100	220,115.00	0.23
106	600030	中信证券	8,300	209,990.00	0.22
107	002594	比亚迪	4,400	209,748.00	0.22
108	000709	河钢股份	81,100	209,238.00	0.22
109	002092	中泰化学	30,600	207,774.00	0.22
110	600741	华域汽车	7,900	205,321.00	0.22
111	000039	中集集团	20,800	204,256.00	0.21
112	03800	保利协鑫能源	747,000	197,398.56	0.21
113	600808	马钢股份	64,200	197,094.00	0.21
114	00576	浙江沪杭甬	30,000	190,801.14	0.20
115	000932	华菱钢铁	37,900	181,162.00	0.19
116	600837	海通证券	11,700	180,882.00	0.19
117	600637	东方明珠	19,200	179,712.00	0.19
118	601288	农业银行	48,700	179,703.00	0.19
119	01359	中国信达	112,000	177,579.43	0.19
120	000401	冀东水泥	10,300	175,203.00	0.18
121	01169	海尔电器	8,000	174,497.94	0.18
122	601601	中国太保	4,600	174,064.00	0.18
123	00489	东风集团股份	26,000	170,717.75	0.18
124	600000	浦发银行	13,800	170,706.00	0.18
125	600801	华新水泥	6,400	169,152.00	0.18
126	000425	徐工机械	30,200	165,194.00	0.17
127	002202	金风科技	13,800	164,910.00	0.17
128	600010	包钢股份	123,200	162,624.00	0.17
129	603288	海天味业	1,500	161,265.00	0.17
130	600886	国投电力	17,500	160,650.00	0.17
131	600839	四川长虹	54,800	159,468.00	0.17
132	601398	工商银行	27,100	159,348.00	0.17
133	01112	H & H 国际控股	5,500	158,888.98	0.17

134	02314	理文造纸	30,000	158,553.06	0.17
135	601992	金隅集团	42,300	157,779.00	0.17
136	01177	中国生物制药	16,000	156,224.03	0.16
137	601117	中国化学	24,200	155,848.00	0.16
138	00780	同程艺龙	12,400	155,285.25	0.16
139	00148	建滔集团	7,000	154,880.36	0.16
140	000825	太钢不锈	37,600	153,784.00	0.16
141	02689	玖龙纸业	21,000	152,372.18	0.16
142	03320	华润医药	23,500	152,197.50	0.16
143	000898	鞍钢股份	44,500	149,075.00	0.16
144	01810	小米集团-W	15,400	148,710.23	0.16
145	000778	新兴铸管	35,600	148,452.00	0.16
146	603993	洛阳钼业	33,700	146,932.00	0.15
147	000630	铜陵有色	62,900	146,557.00	0.15
148	01313	华润水泥控股	16,000	142,178.20	0.15
149	00144	招商局港口	12,000	141,676.56	0.15
150	600782	新钢股份	26,900	137,997.00	0.14
151	002183	怡亚通	32,400	136,404.00	0.14
152	601988	中国银行	36,900	136,161.00	0.14
153	00981	中芯国际	12,500	133,695.17	0.14
154	600027	华电国际	36,300	133,221.00	0.14
155	01093	石药集团	8,000	133,148.74	0.14
156	002110	三钢闽光	14,100	131,976.00	0.14
157	600282	南钢股份	38,100	131,445.00	0.14
158	000063	中兴通讯	3,700	130,943.00	0.14
159	02688	新奥能源	1,700	129,668.63	0.14
160	601233	桐昆股份	8,600	128,914.00	0.14
161	600352	浙江龙盛	8,900	128,783.00	0.14
162	601985	中国核电	25,700	128,500.00	0.13
163	601012	隆基股份	5,100	126,633.00	0.13
164	03808	中国重汽	8,500	126,546.84	0.13
165	601877	正泰电器	4,700	125,960.00	0.13
166	01208	五矿资源	60,000	125,767.51	0.13
167	01378	中国宏桥	29,500	124,199.90	0.13
168	601866	中远海发	47,900	124,061.00	0.13
169	600373	中文传媒	9,100	123,851.00	0.13
170	002352	顺丰控股	3,300	122,727.00	0.13
171	600276	恒瑞医药	1,400	122,528.00	0.13
172	02018	瑞声科技	2,000	121,826.08	0.13
173	600959	江苏有线	29,800	118,604.00	0.12
174	600022	山东钢铁	81,100	115,973.00	0.12
175	600567	山鹰纸业	30,700	115,739.00	0.12
176	002415	海康威视	3,500	114,590.00	0.12
177	600219	南山铝业	50,700	113,568.00	0.12

178	002739	万达电影	6,200	112,530.00	0.12
179	600009	上海机场	1,400	110,250.00	0.12
180	600346	恒力石化	6,800	109,344.00	0.11
181	002078	太阳纸业	11,000	108,240.00	0.11
182	00363	上海实业控股	8,000	107,493.60	0.11
183	000830	鲁西化工	10,000	105,100.00	0.11
184	600516	方大炭素	8,600	104,576.00	0.11
185	02799	中国华融	94,000	103,570.08	0.11
186	600176	中国巨石	9,500	103,550.00	0.11
187	601211	国泰君安	5,600	103,544.00	0.11
188	600196	复星医药	3,800	101,080.00	0.11
189	002091	江苏国泰	14,700	100,989.00	0.11
190	01066	威高股份	12,000	100,399.02	0.11
191	00152	深圳国际	6,500	99,682.40	0.10
192	01044	恒安国际	2,000	99,431.58	0.10
193	600018	上港集团	17,200	99,244.00	0.10
194	600307	酒钢宏兴	47,900	98,674.00	0.10
195	00836	华润电力	10,000	97,998.33	0.10
196	600820	隧道股份	16,200	97,848.00	0.10
197	601688	华泰证券	4,800	97,488.00	0.10
198	600297	广汇汽车	29,800	97,148.00	0.10
199	601333	广深铁路	31,400	96,084.00	0.10
200	00392	北京控股	3,000	96,072.41	0.10
201	600406	国电南瑞	4,500	95,310.00	0.10
202	002131	利欧股份	32,000	95,040.00	0.10
203	600710	苏美达	17,100	94,905.00	0.10
204	600500	中化国际	17,800	94,340.00	0.10
205	600547	山东黄金	2,880	93,945.60	0.10
206	600177	雅戈尔	13,400	93,398.00	0.10
207	000878	云南铜业	6,700	91,522.00	0.10
208	002475	立讯精密	2,500	91,250.00	0.10
209	03396	联想控股	5,500	87,105.65	0.09
210	002493	荣盛石化	7,000	86,730.00	0.09
211	00966	中国太平	5,000	86,532.35	0.09
212	002456	欧菲光	5,500	85,800.00	0.09
213	600584	长电科技	3,900	85,722.00	0.09
214	002241	歌尔股份	4,300	85,656.00	0.09
215	601098	中南传媒	7,100	84,774.00	0.09
216	000960	锡业股份	8,100	84,564.00	0.09
217	601598	中国外运	19,800	84,348.00	0.09
218	601018	宁波港	21,800	82,840.00	0.09
219	601727	上海电气	16,600	82,668.00	0.09
220	000703	恒逸石化	5,800	80,736.00	0.08
221	600332	白云山	2,200	78,342.00	0.08

222	600150	中国船舶	3,600	78,336.00	0.08
223	00636	嘉里物流	6,500	77,905.99	0.08
224	01193	华润燃气	2,000	76,678.77	0.08
225	601633	长城汽车	8,300	73,455.00	0.08
226	02382	舜宇光学科技	600	72,504.43	0.08
227	02128	中国联塑	8,000	71,590.74	0.08
228	600096	云天化	13,500	71,550.00	0.08
229	02313	申洲国际	700	71,420.54	0.07
230	601989	中国重工	13,600	71,264.00	0.07
231	002422	科伦药业	3,000	70,470.00	0.07
232	00581	中国东方集团	24,000	69,440.87	0.07
233	601991	大唐发电	28,100	68,845.00	0.07
234	000050	深天马 A	4,200	68,418.00	0.07
235	600703	三安光电	3,700	67,932.00	0.07
236	600037	歌华有线	7,500	67,575.00	0.07
237	601928	凤凰传媒	8,800	66,968.00	0.07
238	600023	浙能电力	16,700	66,132.00	0.07
239	000776	广发证券	4,300	65,231.00	0.07
240	002001	新和成	2,800	65,128.00	0.07
241	603858	步长制药	3,140	64,746.80	0.07
242	600497	驰宏锌锗	14,700	64,386.00	0.07
243	002236	大华股份	3,200	63,616.00	0.07
244	600489	中金黄金	7,500	63,600.00	0.07
245	000963	华东医药	2,600	63,388.00	0.07
246	02357	中航科工	20,000	62,883.76	0.07
247	00384	中国燃气	2,400	62,776.26	0.07
248	000538	云南白药	700	62,601.00	0.07
249	02020	安踏体育	1,000	62,480.66	0.07
250	600977	中国电影	4,100	62,402.00	0.07
251	600079	人福医药	4,600	62,146.00	0.07
252	03933	联邦制药	12,000	61,056.36	0.06
253	00570	中国中药	18,000	60,626.39	0.06
254	600271	航天信息	2,600	60,242.00	0.06
255	002180	纳思达	1,800	59,256.00	0.06
256	601336	新华保险	1,200	58,980.00	0.06
257	600569	安阳钢铁	22,500	57,375.00	0.06
258	000513	丽珠集团	1,700	57,290.00	0.06
259	601828	美凯龙	5,000	56,650.00	0.06
260	600998	九州通	4,000	56,600.00	0.06
261	600058	五矿发展	7,000	56,140.00	0.06
262	06862	海底捞	2,000	56,075.83	0.06
263	600380	健康元	5,400	55,890.00	0.06
264	601628	中国人寿	1,600	55,792.00	0.06
265	000156	华数传媒	5,300	55,332.00	0.06

266	000028	国药一致	1,200	54,432.00	0.06
267	000034	神州数码	2,700	53,595.00	0.06
268	002120	韵达股份	1,600	53,280.00	0.06
269	600787	中储股份	10,200	53,142.00	0.06
270	600999	招商证券	2,900	53,041.00	0.06
271	600535	天士力	3,400	52,428.00	0.05
272	01333	中国忠旺	18,400	51,260.11	0.05
273	601929	吉视传媒	23,900	50,907.00	0.05
274	600757	长江传媒	8,200	50,512.00	0.05
275	000413	东旭光电	15,000	50,400.00	0.05
276	00867	康哲药业	5,000	50,253.26	0.05
277	601216	君正集团	15,800	49,454.00	0.05
278	03908	中金公司	3,600	48,436.62	0.05
279	000623	吉林敖东	2,900	47,937.00	0.05
280	01347	华虹半导体	3,000	47,619.66	0.05
281	000999	华润三九	1,500	47,520.00	0.05
282	601138	工业富联	2,600	47,502.00	0.05
283	300015	爱尔眼科	1,200	47,472.00	0.05
284	600958	东方证券	4,300	46,268.00	0.05
285	603259	药明康德	500	46,060.00	0.05
286	000423	东阿阿胶	1,300	45,981.00	0.05
287	000661	长春高新	100	44,700.00	0.05
288	601019	山东出版	6,300	43,785.00	0.05
289	600511	国药股份	1,600	43,664.00	0.05
290	000166	申万宏源	8,500	43,520.00	0.05
291	600295	鄂尔多斯	4,800	43,296.00	0.05
292	601003	柳钢股份	7,400	41,810.00	0.04
293	600056	中国医药	3,100	40,455.00	0.04
294	600085	同仁堂	1,400	39,452.00	0.04
295	000553	安道麦 A	3,900	39,000.00	0.04
296	601377	兴业证券	5,500	38,940.00	0.04
297	01888	建滔积层板	4,500	38,939.56	0.04
298	600062	华润双鹤	2,800	36,540.00	0.04
299	601998	中信银行	5,900	36,403.00	0.04
300	300760	迈瑞医疗	200	36,380.00	0.04
301	600420	现代制药	4,000	35,760.00	0.04
302	002019	亿帆医药	2,200	35,750.00	0.04
303	00656	复星国际	3,500	35,616.21	0.04
304	603995	甬金股份	1,259	34,194.44	0.04
305	601788	光大证券	2,600	34,060.00	0.04
306	02186	绿叶制药	6,500	34,003.81	0.04
307	601801	皖新传媒	6,100	33,428.00	0.04
308	000078	海王生物	8,900	33,197.00	0.03
309	600377	宁沪高速	2,900	32,538.00	0.03

310	600398	海澜之家	4,200	32,256.00	0.03
311	600572	康恩贝	5,200	31,980.00	0.03
312	601238	广汽集团	2,600	30,394.00	0.03
313	300433	蓝思科技	2,100	29,022.00	0.03
314	601811	新华文轩	2,200	29,018.00	0.03
315	600566	济川药业	1,200	29,016.00	0.03
316	600350	山东高速	5,800	28,478.00	0.03
317	300413	芒果超媒	800	27,968.00	0.03
317	601212	白银有色	7,600	27,968.00	0.03
318	601901	方正证券	3,200	27,744.00	0.03
319	002294	信立泰	1,300	25,922.00	0.03
320	601949	中国出版	4,000	25,320.00	0.03
321	00460	四环医药	30,000	24,992.26	0.03
322	600315	上海家化	800	24,752.00	0.03
323	01530	三生制药	2,500	22,618.45	0.02
324	002437	誉衡药业	7,200	21,816.00	0.02
325	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.02
326	002736	国信证券	1,700	21,335.00	0.02
327	001965	招商公路	2,200	19,294.00	0.02
328	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.02
329	600025	华能水电	4,200	17,724.00	0.02
330	601881	中国银河	1,500	17,415.00	0.02
331	600989	宝丰能源	1,800	17,118.00	0.02
332	000708	中信特钢	600	13,758.00	0.01
333	601298	青岛港	2,000	13,740.00	0.01
334	002938	鹏鼎控股	300	13,470.00	0.01
335	600299	安迪苏	1,100	12,166.00	0.01
336	601319	中国人保	1,400	10,626.00	0.01
337	603233	大参林	200	10,450.00	0.01
338	001872	招商港口	600	10,296.00	0.01
339	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.01
340	601066	中信建投	200	6,080.00	0.01

注：所用证券代码采用当地市场代码。

#### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	12,880,548.20	13.51
2	03323	中国建材	2,242,157.81	2.35
3	600519	贵州茅台	2,206,310.00	2.31
4	600887	伊利股份	2,205,333.00	2.31

5	601668	中国建筑	2,142,655.00	2.25
6	06808	高鑫零售	1,834,510.66	1.92
7	000002	万科 A	1,678,328.00	1.76
8	601318	中国平安	1,543,580.00	1.62
9	01099	国药控股	1,521,973.51	1.60
10	000858	五粮液	1,498,592.96	1.57
11	601939	建设银行	1,491,692.00	1.56
12	00267	中信股份	1,461,741.73	1.53
13	601390	中国中铁	1,320,044.00	1.38
14	600028	中国石化	1,319,990.00	1.38
15	01918	融创中国	1,318,880.00	1.38
16	600655	豫园股份	1,313,715.20	1.38
17	002024	苏宁易购	1,294,196.00	1.36
18	02319	蒙牛乳业	1,267,534.53	1.33
19	300498	温氏股份	1,241,614.02	1.30
20	000333	美的集团	1,237,017.70	1.30

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	1,771,353.96	1.86
2	06808	高鑫零售	1,357,252.77	1.42
3	600519	贵州茅台	1,285,377.40	1.35
4	002024	苏宁易购	1,241,757.00	1.30
5	03669	永达汽车	830,336.20	0.87
6	03323	中国建材	786,478.47	0.82
7	601668	中国建筑	777,921.00	0.82
8	00881	中升控股	770,781.36	0.81
9	00493	国美零售	757,672.48	0.79
10	000858	五粮液	745,670.00	0.78
11	03969	中国通号	700,219.64	0.73
12	600887	伊利股份	606,000.00	0.64
13	600694	大商股份	598,441.00	0.63
14	000333	美的集团	532,254.00	0.56
15	01099	国药控股	523,369.70	0.55
16	601318	中国平安	508,091.00	0.53
17	01958	北京汽车	458,764.07	0.48
18	00267	中信股份	458,017.27	0.48
19	601933	永辉超市	454,582.00	0.48
20	600048	保利地产	428,091.00	0.45

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	131,670,287.83
卖出股票收入（成交）总额	45,234,864.33

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）	3,813.76	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,813.76	0.00

### 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	128080	顺丰转债	32	3,813.76	0.00
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 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 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。

### 8.11.2 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 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设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，主要采取复制策略，建设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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	82,588.85
2	应收证券清算款	137,358.66
3	应收股利	11,311.72
4	应收利息	1,986.02
5	应收申购款	384,065.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	617,310.88

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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

份额级别	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	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	1,942	19,673.15	10,455,224.52	27.37%	27,750,025.82	72.63%
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	17,286	3,044.40	-	-	52,625,536.43	100.00%
合计	19,228	4,723.88	10,455,224.52	11.51%	80,375,562.25	88.49%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	462,879.01	1.21%
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	244,803.69	0.47%
	合计	707,682.70	0.78%

### 9.3 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	份额级别	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	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	10~50
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	0
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	10~50
	合计	10~50

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有	10,002,444.69	11.01%	10,000,000.00	11.01%	不少于三年

资金					
基金管理人高级管理人员	253,246.49	0.28%	199,984.00	0.22%	-
基金经理等人员	122,165.07	0.13%	120,000.00	0.13%	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,377,856.25	11.43%	10,319,984.00	11.36%	-

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
基金合同生效日（2019 年 7 月 16 日）基金份额总额	44,993,831.21	79,390,496.42
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,919,012.96	21,705,093.18
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	13,707,593.83	48,470,053.17
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	38,205,250.34	52,625,536.43

注：本基金合同于 2019 年 7 月 16 日生效。

## §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 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 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 50,000 元人民币。本基金本报告期内选聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

### 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	
国泰君安证券	2	96,900,164.49	54.89%	13,900.29	28.81%	-
方正证券	2	37,848,469.15	21.44%	16,328.24	33.84%	-
西部证券	1	22,580,450.75	12.79%	9,739.49	20.19%	-
中信证券	1	19,204,479.17	10.88%	8,279.23	17.16%	-

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本基金合同于 2019 年 7 月 16 日生效，除本表列示外，本基金还选择了北京高华证券、长江证券、东方证券、广发证券、华泰证券、中金公司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。

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
国泰君安证券	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-

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	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-07-17
2	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-07-25
3	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金在 2019 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-08-12
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增万和证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-08-19
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-08-30
6	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》修订旗下基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-10-21

## §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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

## §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注册的文件；

13.1.2 《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金基金合同》；

13.1.3 《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式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