

**华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数
证券投资基金
2020 年中期报告
2020 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十九日

§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。本中期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 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	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.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 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
7.7 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
7.8 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.....	49
7.9 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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55

§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	566,515,418.00 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		北京市顺义区安庆大街甲3号院	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	41,337,687.65
本期利润	50,526,307.38
加权平均基金份额本期利润	0.1232
本期加权平均净值利润率	9.81%
本期基金份额净值增长率	9.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	211,669,916.36
期末可供分配基金份额利润	0.3736
期末基金资产净值	778,185,334.36
期末基金份额净值	1.3736
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	44.45%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.62%	0.88%	8.35%	0.86%	1.27%	0.02%

过去三个月	16.84%	0.93%	14.49%	0.92%	2.35%	0.01%
过去六个月	9.32%	1.53%	5.80%	1.53%	3.52%	0.00%
过去一年	21.71%	1.22%	14.01%	1.22%	7.70%	0.00%
自基金转型起至今	44.45%	1.37%	34.92%	1.37%	9.53%	0.00%

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
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 9 月 17 日至 2020 年 6 月 30 日)



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。

§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、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、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、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、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，2020 年在基金分类排名中（截至 2020 年 6 月 30 日数据），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）”中排序 1/123；华夏鼎利债券 (A 类)和华夏鼎沛债券 (A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（A 类）”中分别排序 2/248 和 6/248；华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金（A 类）”中排序 2/345；华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 9/22；华夏创新前沿股票和华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 2/203 和 10/203；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 1/10；华夏医疗健康混合(A 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（A 类）”中排序 5/225；华夏乐享健康混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）”中排序 5/490；华夏磐泰混合(LOF)在“混合基金-偏债型基金-偏债型基金（A 类）”中分别排序 6/125；华夏移动互联混合（QDII）和华夏新时代混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 4/36 和 7/36；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数(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 6/21，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 3/78；华夏消费 ETF 及

华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 7/35 和 4/35；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 5/53；华夏创成长 ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策略指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/17 和 3/17；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 9/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 3/28。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在中国证券报举办的第十七届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏上证 50ETF 荣获“三年期开放式指数型持续优胜金牛基金”奖。在证券时报社主办，在晨星资讯、上海证券和济安金信提供数据和研究支持的第十五届中国基金业明星基金奖评选中，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司”，华夏回报混合荣获“五年持续回报绝对收益策略明星基金”。

在客户服务方面，2020 年上半年度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端部分基金上线定投止盈功能，同时对资料上传功能进行升级优化，为广大投资者管理定期定额交易、以及业务办理提供了便利；（2）华夏基金微信公众号上线货币基金收益播报推送功能，方便客户及时了解持有的货币基金收益变动情况；（3）与苏州农商银行、渤海银行、中天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；（4）开展“难忘，因为不用记”、“凡是家人，都有户口本”、“人未动，心已跳”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		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	-	10 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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为 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 2020 年 6 月 30 日，MSCI 中国 A 股国际通指数成份股 474 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。

2020 年上半年，受新冠病毒疫情影响，全球经济从 2019 年 4 季度缓中趋稳转向继续走弱。国际方面，欧美在 3 月进入疫情暴发期，海外疫情暴发失控，总需求和投资都面临紧缩压力，部分国家经济已陷入严重衰退。为维持经济稳定，欧美各国寻求大规模非常举措，3 月初，美联储紧急降息 50 点后引发了全球宽松浪潮，此外美联储开启无限量宽松，美国还出台了 2.2 万亿美元的巨量刺激，市场的流动性危机逐步缓解。6 月，采购经理人指数再次出现大幅增长，全球经济活动现已逐

渐显现出触底态势。国内方面，春节前后新冠疫情暴发后全国各地采取了严格的隔离防护措施，企业推迟复工，对 1-2 月经济活动造成了严重的短期冲击。随着国内疫情得到控制，疫情给生产带来的负面影响正逐渐减弱，2 月中国制造业 PMI 录得统计以来新低 35.7，3 月回升至 52，企业复工复产进度加快。2 季度，国内 GDP 增速已回升至 3.2% 水平。

市场方面，1 月份 A 股市场持续 2019 年牛市行情，疫情暴发的春节后 A 股反弹走牛。但 3 月国外疫情的暴发叠加国际油价和大宗商品下调等事件使得 A 股再度下跌，北向资金持续净流出，市场震荡幅度加剧。2 季度，包括美国、日本、中国等在内的主要经济体股市已从 3 月低谷反弹，总体来看全球股市平均已恢复至 1 月中旬水平的 85% 左右，部分经济体的股市已收复了全部损失，纳斯达克等指数甚至再创新高；全球股市的波动性也较 3 月峰值有所下降，但仍高于长期平均水平。在经历 2 季度的经济复苏后，A 股基本面的诸多正面变化已基本反映在股价上，市场对经济活动，尤其是消费端的复苏持较为乐观的态度，北上资金余额也跟随富时罗素 A 股第一阶段扩容收官创年内新高。

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 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3736 元，本报告期份额净值增长率为 9.32%，同期业绩比较基准增长率 5.80%。本基金本报告期跟踪偏离度为+3.52%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美联储预计继续维持当前宽松格局，全球经济延续逐步复苏态势。国内上半年经济稳步复苏为下半年持续恢复打下了较为坚实的基础，财税金融以及就业支持方面的宏观政策效应将进一步显现。当前境外疫情仍在快速蔓延扩散，世界经济重启举步维艰，国际政治冲突摩擦加剧，国内需求恢复仍将受到一定制约，稳企业、保就业仍面临较大压力，但总体来看，下半年以及下一阶段我国经济运行会继续维持向好的态势。市场方面，经济景气有望上行，企业盈利趋于好转，预计下半年 A 股市场整体向好，如经济回暖进一步确认，有望呈现价值风格优于成长风格的局面。但

若中美摩擦超预期，则市场可能波动增加。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	20,686,482.13	10,606,439.56
结算备付金		13,799,484.57	4,912,205.20
存出保证金		2,849,706.22	1,311,483.80
交易性金融资产	6.4.7.2	742,014,197.95	543,574,713.90
其中：股票投资		741,925,897.95	542,979,713.90
基金投资		-	-
债券投资		88,300.00	595,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		18,457,989.23	1,368,255.59
应收利息	6.4.7.5	6,778.77	10,957.46
应收股利		2,500.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		797,817,138.87	561,784,055.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,110,790.20	3,760,625.35
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		225,978.11	236,497.52
应付托管费		45,195.59	47,299.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	303,533.20	260,111.10
应交税费		7,102.16	3,374.08
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	6,939,205.25	1,309,742.78
负债合计		19,631,804.51	5,617,650.33
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	566,515,418.00	442,621,733.00
未分配利润	6.4.7.10	211,669,916.36	113,544,672.18
所有者权益合计		778,185,334.36	556,166,405.18
负债和所有者权益总计		797,817,138.87	561,784,055.51

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3736 元，基金份额总额 566,515,418.00 份。

6.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		52,866,990.24	138,161,046.86
1.利息收入		100,925.29	80,090.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,319.43	79,187.38
债券利息收入		112.79	903.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		516.44	-
证券出借利息收入		31,976.63	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		44,097,986.41	33,439,185.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	38,999,772.07	25,740,744.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	206,817.85	404,231.23
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	316,291.26	1,888,750.48
股利收益	6.4.7.17	4,575,105.23	5,405,459.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	9,188,619.73	104,668,774.75

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-520,541.19	-27,004.47
减：二、费用		2,340,682.86	2,053,262.86
1.管理人报酬		1,292,561.40	1,325,920.19
2.托管费		258,512.23	265,184.05
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	598,404.39	240,626.95
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		1,045.13	9,163.68
7.其他费用	6.4.7.21	190,159.71	212,367.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		50,526,307.38	136,107,784.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,526,307.38	136,107,784.00

6.3 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	442,621,733.00	113,544,672.18	556,166,405.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	50,526,307.38	50,526,307.38
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）	123,893,685.00	47,598,936.80	171,492,621.80
其中：1.基金申购款	480,000,000.00	136,657,333.34	616,657,333.34
2.基金赎回款	-356,106,315.00	-89,058,396.54	-445,164,711.54
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）	566,515,418.00	211,669,916.36	778,185,334.36
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	136,107,784.00	136,107,784.00
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）	-128,987,829.00	-10,553,829.10	-139,541,658.10
其中：1.基金申购款	99,000,000.00	9,049,481.43	108,049,481.43
2.基金赎回款	-227,987,829.00	-19,603,310.53	-247,591,139.53
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）	473,515,418.00	60,882,225.10	534,397,643.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 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）。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	20,686,482.13
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	20,686,482.13

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	685,563,090.72	741,925,897.95	56,362,807.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	88,300.00	88,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	88,300.00	88,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	685,651,390.72	742,014,197.95	56,362,807.23

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	25,968,960.00	-	-	-
其中：股指期货	25,968,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	25,968,960.00	-	-	-

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
IF2007	沪深 300 股指 期货 IF2007 合约	6	7,412,400.00	305,580.00	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。
IF2009	沪深 300 股指 期货 IF2009 合约	6	7,321,680.00	174,060.00	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。
IF2008	沪深 300 股指 期货 IF2008 合约	5	6,122,700.00	43,620.00	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。
IC2007	中证 500 股指 期货 IC2007 合约	4	4,639,520.00	133,400.00	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。
IC2008	中证 500 股指 期货 IC2008 合约	1	1,146,000.00	16,680.00	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					673,340.00
股指期货投资本期收益					316,291.26

股指期货投资本期公允价值变动	376,840.00
----------------	------------

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,271.85
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	2,723.48
应收债券利息	8.33
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	1,743.71
其他	31.40
合计	6,778.77

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	303,533.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	303,533.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 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	94,481.66
应付指数使用费	280,907.80
应退替代款	5,835,108.72
可退替代款	728,707.07
合计	6,939,205.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	442,621,733.00	442,621,733.00
本期申购	480,000,000.00	480,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-356,106,315.00	-356,106,315.00
本期末	566,515,418.00	566,515,418.00

6.4.7.10 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	228,076,481.29	-114,531,809.11	113,544,672.18
本期利润	41,337,687.65	9,188,619.73	50,526,307.38
本期基金份额交易产生的变动数	79,411,272.55	-31,812,335.75	47,598,936.80
其中：基金申购款	281,510,177.65	-144,852,844.31	136,657,333.34
基金赎回款	-202,098,905.10	113,040,508.56	-89,058,396.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	348,825,441.49	-137,155,525.13	211,669,916.36

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	37,024.42
其他	572.03
合计	68,319.43

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	33,323,581.82
股票投资收益——赎回差价收入	5,676,190.25
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	38,999,772.07

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	244,648,208.92
减：卖出股票成本总额	211,324,627.10
买卖股票差价收入	33,323,581.82

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	438,914,071.35
减：现金支付赎回款总额	176,822,346.35
减：赎回股票成本总额	256,415,534.75
赎回差价收入	5,676,190.25

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,173,094.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	966,100.00
减：应收利息总额	176.29
买卖债券差价收入	206,817.85

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股指期货投资收益	316,291.26
合计	316,291.26

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,575,105.23
其中：证券出借权益补偿收入	20,016.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,575,105.23

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	8,811,779.73
——股票投资	8,811,779.73
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	376,840.00
——权证投资	-

——期货投资	376,840.00
4.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	9,188,619.73

6.4.7.19 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	9,375.96
替代损益	-529,917.15
其他	-
合计	-520,541.19

6.4.7.20 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	598,404.39
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	598,404.39

6.4.7.21 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	5,198.81
指数使用费	90,479.24
合计	190,159.71

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金无或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
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
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	17,314,662.35	2.92%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	103,934.14	8.86%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	7,468.44	2.92%	4,070.19	1.34%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,292,561.40	1,325,920.19
其中：支付销售机构的客户维护费	16,351.13	8,721.74

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	258,512.23	265,184.05

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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 2020年1月1日至2020年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末证券出借 业务余额
中信证券	2,989,577.00	2,195.43	315,018.00	360.78

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	339,199,281.00	59.87%	197,307,581.00	44.58%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	20,686,482.13	30,722.98	12,083,785.11	40,140.92

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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 92,284,440.00 元（上年度可比期间：115,413,660.00 元），支付给中信期货的佣金为 2,302.01 元（上年度可比期间：2,827.62 元）。

②于 2020 年 6 月 30 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 5,106,015.80 元，占基金资产净值的比例为 0.66%(2019 年 6 月 30 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 5,787,734.80 元，占基金资产净值的比例为 1.08%)。

③于 2020 年 6 月 30 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 2,659,416.00 元，占基金资产净值的比例为 0.34%(2019 年 6 月 30 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 3,246,320.00 元，占基金资产净值的比例为 0.61%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新发流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新发流通	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-

				受限							
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新发流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-	
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新发流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-	
688096	京源环保	2020-03-31	2020-10-09	新发流通受限	14.34	21.42	4,485	64,314.90	96,068.70	-	
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新发流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-	
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	配股流通受限	5.00	6.54	13,080	65,400.00	85,543.20	-	
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新发流通受限	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-	
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新发流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-	

300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新发 流通 受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新发 流通 受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
6.4.12.1.2 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：张)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
128112	歌尔转2	2020-06-12	2020-07-13	新发 流通 受限	100.00	100.00	636	63,600.00	63,600.00	-
128114	正邦转债	2020-06-17	2020-07-15	新发 流通 受限	100.00	100.00	247	24,700.00	24,700.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

合约编号	证券代	证券	成交时间	出借到期	期末	数量（单	期末估值总
------	-----	----	------	------	----	------	-------

	码	名称		日	估值 单价	位： 股)	额
2020062300000304	002352	顺丰 控股	2020-06-23	2020-07-21	54.70	10,000.00	547,000.00
2020060900000537	601066	中信 建投	2020-06-09	2020-07-07	39.38	10,000.00	393,800.00
2020062300000217	000876	新 希 望	2020-06-23	2020-07-21	29.80	10,000.00	298,000.00
2020062300000632	601990	南京 证券	2020-06-23	2020-07-07	14.27	15,500.00	221,185.00
2020062300000799	600438	通威 股份	2020-06-23	2020-07-21	17.38	13,200.00	229,416.00
2020062300001742	002127	南极 电商	2020-06-23	2020-07-07	21.17	10,000.00	211,700.00
2020062300001750	002385	大北 农	2020-06-23	2020-07-07	9.11	18,300.00	166,713.00
2020062300001758	601162	天风 证券	2020-06-23	2020-07-07	6.06	25,000.00	151,500.00
2020060900000457	300251	光线 传媒	2020-06-09	2020-07-07	10.91	12,800.00	139,648.00
2020062300000265	002075	沙钢 股份	2020-06-23	2020-07-07	12.50	10,400.00	130,000.00
2020060900000338	002131	利欧 股份	2020-06-09	2020-07-07	3.86	29,500.00	113,870.00
2020062300000201	000723	美锦 能源	2020-06-23	2020-07-21	6.26	19,000.00	118,940.00
2020062300001606	600516	方大 炭素	2020-06-23	2020-07-07	6.28	16,600.00	104,248.00
2020062300000360	300017	网宿 科技	2020-06-23	2020-07-21	8.49	10,000.00	84,900.00
2020062300000173	000027	深圳 能源	2020-06-23	2020-07-21	4.64	18,000.00	83,520.00
2020062300001746	600909	华安 证券	2020-06-23	2020-07-07	6.83	12,000.00	81,960.00
2020062300001752	601727	上海 电气	2020-06-23	2020-07-07	5.04	15,000.00	75,600.00
2020060900000419	300026	红日 药业	2020-06-09	2020-07-07	5.52	13,100.00	72,312.00
2020060900000522	600863	内蒙 华电	2020-06-09	2020-07-07	2.46	25,000.00	61,500.00
2020060900000641	601099	太平 洋	2020-06-09	2020-07-07	3.17	20,000.00	63,400.00
2020062300000189	000598	兴蓉 环境	2020-06-23	2020-07-21	4.60	10,000.00	46,000.00

2020062400000312	000540	中天 金融	2020-06-24	2020-07-08	3.22	10,000.00	32,200.00
合计						333,400.00	3,427,412.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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“6.4.12 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。

6.4.13.3.1 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，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	741,925,897.95	95.34	542,979,713.90	97.63
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	88,300.00	0.01	595,000.00	0.11
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	742,014,197.95	95.35	543,574,713.90	97.74

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。

6.4.13.4.3.2 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	+5%	37,615,762.76	27,571,441.77
	-5%	-37,615,762.76	-27,571,441.77

6.4.14 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 2020 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 741,894,706.50 元，第二层次的余额为 96,068.70 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2019 年 12 月 31 日止：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。）

(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。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	741,925,897.95	92.99
	其中：股票	741,925,897.95	92.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	88,300.00	0.01
	其中：债券	88,300.00	0.01
	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	34,485,966.70	4.32
8	其他各项资产	21,316,974.22	2.67
9	合计	797,817,138.87	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 3,427,412.00 元，占本基金期末资产净值的 0.44%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,688,994.80	1.63

B	采矿业	17,869,303.68	2.30
C	制造业	383,953,069.83	49.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,766,370.12	2.28
E	建筑业	14,676,581.11	1.89
F	批发和零售业	12,386,753.29	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	19,770,913.71	2.54
H	住宿和餐饮业	837,981.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,541,228.59	5.47
J	金融业	156,599,697.96	20.12
K	房地产业	26,956,365.74	3.46
L	租赁和商务服务业	10,453,315.88	1.34
M	科学研究和技术服务业	6,607,782.00	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	604,128.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,060,050.00	0.14
Q	卫生和社会工作	10,173,159.83	1.31
R	文化、体育和娱乐业	6,473,079.66	0.83
S	综合	483,700.00	0.06
	合计	741,902,475.20	95.34

7.3 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	26,122	38,213,351.36	4.91
2	601318	中国平安	244,503	17,457,514.20	2.24
3	000858	五粮液	91,629	15,679,554.48	2.01
4	600036	招商银行	464,652	15,668,065.44	2.01
5	600276	恒瑞医药	117,856	10,878,108.80	1.40
6	600900	长江电力	494,389	9,363,727.66	1.20
7	300750	宁德时代	53,300	9,293,388.00	1.19
8	002475	立讯精密	159,083	8,168,912.05	1.05
9	603288	海天味业	59,680	7,424,192.00	0.95
10	601166	兴业银行	469,116	7,402,650.48	0.95
11	002714	牧原股份	89,414	7,331,948.00	0.94
12	600000	浦发银行	661,948	7,003,409.84	0.90
13	300760	迈瑞医疗	22,200	6,786,540.00	0.87
14	002415	海康威视	214,876	6,521,486.60	0.84
15	601888	中国中免	42,236	6,505,611.08	0.84
16	601398	工商银行	1,220,200	6,076,596.00	0.78
17	000002	万科A	226,789	5,928,264.46	0.76
18	000001	平安银行	450,188	5,762,406.40	0.74
19	601288	农业银行	1,691,600	5,717,608.00	0.73

20	000661	长春高新	12,700	5,528,310.00	0.71
21	600030	中信证券	211,780	5,106,015.80	0.66
22	600585	海螺水泥	91,915	4,863,222.65	0.62
23	601328	交通银行	885,346	4,541,824.98	0.58
24	600016	民生银行	799,424	4,532,734.08	0.58
25	601668	中国建筑	943,127	4,498,715.79	0.58
26	603259	药明康德	44,140	4,263,924.00	0.55
27	600887	伊利股份	135,916	4,231,065.08	0.54
28	300015	爱尔眼科	94,151	4,090,860.95	0.53
29	000651	格力电器	71,978	4,071,795.46	0.52
30	600048	保利地产	267,660	3,956,014.80	0.51
31	601601	中国太保	144,542	3,938,769.50	0.51
32	002352	顺丰控股	70,700	3,867,290.00	0.50
33	300059	东方财富	188,260	3,802,852.00	0.49
34	002304	洋河股份	35,933	3,777,995.62	0.49
35	300122	智飞生物	37,500	3,755,625.00	0.48
36	000725	京东方 A	787,350	3,676,924.50	0.47
37	000063	中兴通讯	91,500	3,671,895.00	0.47
38	002142	宁波银行	137,690	3,617,116.30	0.46
39	600309	万华化学	72,100	3,604,279.00	0.46
40	601012	隆基股份	87,340	3,557,358.20	0.46
41	600031	三一重工	189,559	3,556,126.84	0.46
42	300498	温氏股份	149,476	3,258,576.80	0.42
43	600588	用友网络	73,859	3,257,181.90	0.42
44	601818	光大银行	904,100	3,236,678.00	0.42
45	000568	泸州老窖	35,261	3,212,982.32	0.41
46	601688	华泰证券	166,500	3,130,200.00	0.40
47	601766	中国中车	545,430	3,038,045.10	0.39
48	000538	云南白药	32,377	3,037,286.37	0.39
49	603986	兆易创新	12,700	2,996,057.00	0.39
50	600104	上汽集团	174,662	2,967,507.38	0.38
51	603501	韦尔股份	14,600	2,948,470.00	0.38
52	002594	比亚迪	40,870	2,934,466.00	0.38
53	601211	国泰君安	169,600	2,927,296.00	0.38
54	000876	新希望	97,000	2,890,600.00	0.37
55	600809	山西汾酒	19,853	2,878,685.00	0.37
56	000895	双汇发展	62,050	2,859,884.50	0.37
57	600999	招商证券	129,090	2,833,525.50	0.36
58	603160	汇顶科技	12,700	2,830,830.00	0.36
59	600050	中国联通	584,567	2,829,304.28	0.36
60	601229	上海银行	320,761	2,662,316.30	0.34
61	601988	中国银行	764,200	2,659,416.00	0.34
62	000166	申万宏源	523,441	2,643,377.05	0.34

63	300601	康泰生物	16,300	2,643,208.00	0.34
64	300413	芒果超媒	40,330	2,629,516.00	0.34
65	600745	闻泰科技	20,500	2,581,975.00	0.33
66	600436	片仔癀	15,097	2,570,264.25	0.33
67	600690	海尔智家	144,768	2,562,393.60	0.33
68	001979	招商蛇口	152,981	2,515,007.64	0.32
69	002555	三七互娱	51,400	2,405,520.00	0.31
70	002371	北方华创	14,000	2,392,740.00	0.31
71	601066	中信建投	60,600	2,386,428.00	0.31
72	600570	恒生电子	22,154	2,385,985.80	0.31
73	601006	大秦铁路	338,503	2,383,061.12	0.31
74	601169	北京银行	479,662	2,350,343.80	0.30
75	600703	三安光电	92,900	2,322,500.00	0.30
76	600837	海通证券	183,736	2,311,398.88	0.30
77	002916	深南电路	13,780	2,308,425.60	0.30
78	601390	中国中铁	456,770	2,292,985.40	0.29
79	600028	中国石化	580,000	2,267,800.00	0.29
80	002241	歌尔股份	75,620	2,220,203.20	0.29
81	300454	深信服	10,700	2,203,772.00	0.28
82	601186	中国铁建	262,300	2,198,074.00	0.28
83	601336	新华保险	49,200	2,178,576.00	0.28
84	600406	国电南瑞	106,491	2,156,442.75	0.28
85	600547	山东黄金	58,031	2,125,095.22	0.27
86	002007	华兰生物	41,060	2,057,516.60	0.26
87	601857	中国石油	486,100	2,036,759.00	0.26
88	601933	永辉超市	216,300	2,028,894.00	0.26
89	601989	中国重工	506,100	2,024,400.00	0.26
90	601138	工业富联	133,600	2,024,040.00	0.26
91	002230	科大讯飞	53,156	1,989,629.08	0.26
92	300014	亿纬锂能	41,373	1,979,698.05	0.25
93	300676	华大基因	12,600	1,964,466.00	0.25
94	300033	同花顺	14,700	1,956,276.00	0.25
95	601899	紫金矿业	444,400	1,955,360.00	0.25
96	000100	TCL 科技	314,100	1,947,420.00	0.25
97	000776	广发证券	136,300	1,924,556.00	0.25
98	000938	紫光股份	44,568	1,915,532.64	0.25
99	300142	沃森生物	36,517	1,912,030.12	0.25
100	600019	宝钢股份	418,606	1,908,843.36	0.25
101	002027	分众传媒	339,640	1,891,794.80	0.24
102	002624	完美世界	32,800	1,890,592.00	0.24
103	000338	潍柴动力	137,400	1,885,128.00	0.24
104	002024	苏宁易购	214,100	1,877,657.00	0.24
105	600346	恒力石化	132,240	1,851,360.00	0.24

106	000596	古井贡酒	12,300	1,847,952.00	0.24
107	300347	泰格医药	17,950	1,828,746.00	0.24
108	601088	中国神华	125,252	1,798,618.72	0.23
109	600763	通策医疗	10,700	1,784,439.00	0.23
110	002050	三花智控	81,295	1,780,360.50	0.23
111	300433	蓝思科技	63,200	1,772,128.00	0.23
112	002311	海大集团	37,100	1,765,589.00	0.23
113	600015	华夏银行	287,548	1,759,793.76	0.23
114	300558	贝达药业	12,500	1,749,750.00	0.22
115	002410	广联达	24,000	1,672,800.00	0.21
116	601009	南京银行	226,350	1,659,145.50	0.21
117	603658	安图生物	10,200	1,656,888.00	0.21
118	601628	中国人寿	60,860	1,656,000.60	0.21
119	002841	视源股份	16,500	1,642,080.00	0.21
120	601155	新城控股	52,163	1,629,572.12	0.21
121	600340	华夏幸福	70,052	1,601,388.72	0.21
122	601100	恒立液压	19,600	1,571,920.00	0.20
123	600438	通威股份	89,500	1,555,510.00	0.20
124	600183	生益科技	52,800	1,545,456.00	0.20
125	002001	新 和 成	52,400	1,524,840.00	0.20
126	600009	上海机场	20,949	1,509,794.43	0.19
127	600741	华域汽车	72,483	1,506,921.57	0.19
128	002271	东方雨虹	37,000	1,503,310.00	0.19
129	300124	汇川技术	39,500	1,500,605.00	0.19
130	600919	江苏银行	261,500	1,482,705.00	0.19
131	300003	乐普医疗	40,400	1,475,408.00	0.19
132	002602	世纪华通	96,100	1,471,291.00	0.19
133	002493	荣盛石化	119,550	1,470,465.00	0.19
134	600196	复星医药	43,121	1,459,645.85	0.19
135	603993	洛阳钼业	394,900	1,449,283.00	0.19
136	600383	金地集团	104,174	1,427,183.80	0.18
137	002600	领益智造	132,400	1,407,412.00	0.18
138	601939	建设银行	221,547	1,397,961.57	0.18
139	002129	中环股份	61,800	1,388,028.00	0.18
140	002236	大华股份	72,050	1,384,080.50	0.18
141	002120	韵达股份	56,440	1,379,958.00	0.18
142	000977	浪潮信息	35,140	1,376,785.20	0.18
143	601225	陕西煤业	188,500	1,359,085.00	0.17
144	601788	光大证券	84,100	1,350,646.00	0.17
145	601877	正泰电器	51,120	1,347,012.00	0.17
146	002044	美年健康	92,468	1,332,463.88	0.17
147	601901	方正证券	185,700	1,314,756.00	0.17
148	600600	青岛啤酒	17,186	1,314,729.00	0.17

149	300529	健帆生物	18,650	1,296,175.00	0.17
150	603659	璞泰来	12,400	1,277,448.00	0.16
151	603939	益丰药房	13,960	1,270,360.00	0.16
152	600958	东方证券	133,800	1,269,762.00	0.16
153	603369	今世缘	31,700	1,261,343.00	0.16
154	601799	星宇股份	9,900	1,257,300.00	0.16
155	002460	赣锋锂业	23,450	1,256,216.50	0.16
156	002812	恩捷股份	18,800	1,237,040.00	0.16
157	600893	航发动力	52,472	1,232,042.56	0.16
158	300628	亿联网络	17,850	1,218,441.00	0.16
159	300482	万孚生物	11,700	1,216,800.00	0.16
160	002127	南极电商	57,000	1,206,690.00	0.16
161	601669	中国电建	347,200	1,201,312.00	0.15
162	600886	国投电力	152,376	1,197,675.36	0.15
163	300253	卫宁健康	51,810	1,188,521.40	0.15
164	600926	杭州银行	133,220	1,188,322.40	0.15
165	601985	中国核电	289,800	1,185,282.00	0.15
166	603833	欧派家居	10,100	1,170,590.00	0.15
167	600521	华海药业	34,060	1,155,655.80	0.15
168	000069	华侨城 A	190,450	1,154,127.00	0.15
169	002049	紫光国微	15,700	1,142,175.00	0.15
170	603882	金域医学	12,700	1,136,650.00	0.15
171	002456	欧菲光	61,210	1,125,651.90	0.14
172	002384	东山精密	37,500	1,123,125.00	0.14
173	600845	宝信软件	18,900	1,116,612.00	0.14
174	600606	绿地控股	180,500	1,115,490.00	0.14
175	603899	晨光文具	20,200	1,102,920.00	0.14
176	601881	中国银河	96,100	1,102,267.00	0.14
177	000768	中航飞机	62,060	1,100,944.40	0.14
178	300136	信维通信	20,700	1,097,514.00	0.14
179	300408	三环集团	39,620	1,097,474.00	0.14
180	300308	中际旭创	17,400	1,096,200.00	0.14
181	300595	欧普康视	15,800	1,095,572.00	0.14
182	600010	宝钢股份	1,012,306	1,093,290.48	0.14
183	002414	高德红外	37,320	1,092,729.60	0.14
184	000425	徐工机械	184,000	1,087,440.00	0.14
185	600332	白云山	33,437	1,081,018.21	0.14
186	002736	国信证券	95,295	1,076,833.50	0.14
187	603517	绝味食品	15,200	1,075,248.00	0.14
188	600536	中国软件	13,500	1,069,200.00	0.14
189	601990	南京证券	74,700	1,065,969.00	0.14
190	600872	中炬高新	18,200	1,065,246.00	0.14
191	002607	中公教育	38,200	1,060,050.00	0.14

192	002032	苏泊尔	14,900	1,057,900.00	0.14
193	601377	兴业证券	150,900	1,033,665.00	0.13
194	300144	宋城演艺	59,560	1,030,388.00	0.13
195	603883	老百姓	10,200	1,020,408.00	0.13
196	600132	重庆啤酒	13,900	1,014,700.00	0.13
197	000860	顺鑫农业	17,800	1,014,244.00	0.13
198	000625	长安汽车	91,952	1,011,472.00	0.13
199	002157	正邦科技	57,800	1,010,344.00	0.13
200	000963	华东医药	39,889	1,009,191.70	0.13
201	603019	中科曙光	26,260	1,008,384.00	0.13
202	600161	天坛生物	22,200	1,006,326.00	0.13
203	603338	浙江鼎力	13,260	1,004,710.20	0.13
204	000656	金科股份	122,700	1,001,232.00	0.13
205	600029	南方航空	193,500	1,000,395.00	0.13
206	600061	国投资本	78,300	996,759.00	0.13
207	601111	中国国航	150,000	991,500.00	0.13
208	601618	中国中冶	393,542	987,790.42	0.13
209	300496	中科创达	12,697	986,556.90	0.13
210	002463	沪电股份	39,400	984,212.00	0.13
211	002252	上海莱士	115,200	974,592.00	0.13
212	000157	中联重科	151,200	972,216.00	0.12
213	603707	健友股份	15,000	968,550.00	0.12
214	002179	中航光电	23,500	963,735.00	0.12
215	601360	三六零	52,480	960,908.80	0.12
216	300383	光环新网	36,600	954,162.00	0.12
217	600352	浙江龙盛	74,000	946,460.00	0.12
218	000066	中国长城	70,800	934,560.00	0.12
219	002299	圣农发展	32,000	928,000.00	0.12
220	300450	先导智能	20,000	924,200.00	0.12
221	002065	东华软件	73,666	922,298.32	0.12
222	600298	安琪酵母	18,600	920,328.00	0.12
223	601727	上海电气	182,500	919,800.00	0.12
224	601162	天风证券	150,300	910,818.00	0.12
225	600674	川投能源	97,864	907,199.28	0.12
226	603799	华友钴业	23,318	906,137.48	0.12
227	300699	光威复材	14,400	903,312.00	0.12
228	002821	凯莱英	3,700	899,100.00	0.12
229	600660	福耀玻璃	43,000	897,410.00	0.12
230	300357	我武生物	14,400	896,400.00	0.12
231	600018	上港集团	213,400	896,280.00	0.12
232	600085	同仁堂	32,837	890,539.44	0.11
233	600115	东方航空	210,176	886,942.72	0.11
234	601872	招商轮船	151,700	884,411.00	0.11

235	002690	美亚光电	16,800	883,680.00	0.11
236	002385	大北农	96,677	880,727.47	0.11
237	002773	康弘药业	17,700	877,920.00	0.11
238	000783	长江证券	130,134	877,103.16	0.11
239	600779	水井坊	14,000	873,880.00	0.11
240	600486	扬农化工	10,500	866,250.00	0.11
241	601319	中国人保	133,400	859,096.00	0.11
242	002373	千方科技	35,800	858,842.00	0.11
243	002439	启明星辰	20,300	854,021.00	0.11
244	600795	XD 国电电	450,700	833,795.00	0.11
245	002185	华天科技	61,600	833,448.00	0.11
246	000786	北新建材	38,900	829,737.00	0.11
247	300212	易华录	14,800	828,800.00	0.11
248	601600	中国铝业	300,100	828,276.00	0.11
249	002466	天齐锂业	35,649	818,144.55	0.11
250	601108	财通证券	79,300	812,825.00	0.10
251	600522	中天科技	70,800	810,660.00	0.10
252	002146	荣盛发展	99,742	807,910.20	0.10
253	600705	中航资本	203,536	806,002.56	0.10
254	002223	鱼跃医疗	22,000	800,800.00	0.10
255	603589	口子窖	15,700	799,130.00	0.10
256	300316	晶盛机电	32,200	796,628.00	0.10
257	600760	中航沈飞	24,200	794,244.00	0.10
258	002202	金风科技	78,984	787,470.48	0.10
259	000703	恒逸石化	86,150	786,549.50	0.10
260	002603	以岭药业	25,200	785,988.00	0.10
261	002153	石基信息	20,137	785,947.11	0.10
262	002739	万达电影	51,300	783,351.00	0.10
263	002925	盈趣科技	13,500	782,190.00	0.10
264	600315	上海家化	16,200	775,980.00	0.10
265	600801	华新水泥	32,700	775,317.00	0.10
266	000021	深科技	35,500	774,965.00	0.10
267	002557	洽洽食品	14,300	774,917.00	0.10
268	601800	中国交建	105,300	772,902.00	0.10
269	601607	上海医药	41,866	769,497.08	0.10
270	600998	九州通	41,200	767,144.00	0.10
271	601919	中远海控	220,600	765,482.00	0.10
272	000513	丽珠集团	15,900	763,359.00	0.10
273	002180	纳思达	23,000	756,930.00	0.10
274	600004	白云机场	49,500	754,380.00	0.10
275	000961	中南建设	84,700	753,830.00	0.10
276	600118	中国卫星	24,427	753,084.41	0.10
277	600867	通化东宝	43,076	750,814.68	0.10

278	300251	光线传媒	68,700	749,517.00	0.10
279	600109	国金证券	65,600	748,496.00	0.10
280	300661	圣邦股份	2,450	747,372.50	0.10
281	601231	环旭电子	34,200	746,928.00	0.10
282	600111	北方稀土	80,127	746,783.64	0.10
283	600637	东方明珠	76,693	740,087.45	0.10
284	600895	张江高科	36,300	739,431.00	0.10
285	002422	科伦药业	35,044	735,924.00	0.09
286	300146	汤臣倍健	37,200	732,468.00	0.09
287	002511	中顺洁柔	32,800	731,440.00	0.09
288	002152	广电运通	56,400	729,816.00	0.09
289	603866	桃李面包	14,200	722,638.00	0.09
290	002601	龙蟠佰利	39,000	721,500.00	0.09
291	300285	国瓷材料	21,400	717,114.00	0.09
292	600511	国药股份	17,600	715,792.00	0.09
293	002405	四维图新	43,300	714,017.00	0.09
294	600176	中国巨石	78,000	713,700.00	0.09
295	600011	华能国际	167,600	707,272.00	0.09
296	002465	海格通信	54,648	707,145.12	0.09
297	601021	春秋航空	20,056	706,773.44	0.09
298	600489	中金黄金	77,248	706,046.72	0.09
299	001914	招商积余	22,900	703,717.00	0.09
300	601018	宁波港	196,300	700,791.00	0.09
301	600498	烽火通信	24,200	699,622.00	0.09
302	600885	宏发股份	17,400	698,088.00	0.09
303	300207	欣旺达	36,900	697,410.00	0.09
304	601555	东吴证券	84,619	690,491.04	0.09
305	002013	中航机电	87,200	688,880.00	0.09
306	000050	深天马 A	44,700	686,592.00	0.09
307	600380	XD 健康元	42,100	683,704.00	0.09
308	000975	银泰黄金	43,600	683,648.00	0.09
309	603712	七一二	17,800	683,164.00	0.09
310	603858	步长制药	23,644	682,129.40	0.09
311	600487	亨通光电	41,460	680,358.60	0.09
312	002242	九阳股份	18,200	678,314.00	0.09
313	002558	巨人网络	38,800	675,120.00	0.09
314	600177	雅戈尔	113,100	674,076.00	0.09
315	002294	信立泰	22,726	674,053.16	0.09
316	600739	辽宁成大	35,399	670,103.07	0.09
317	002507	涪陵榨菜	18,538	667,553.38	0.09
318	002075	沙钢股份	53,300	666,250.00	0.09
319	600271	航天信息	40,800	662,592.00	0.09
320	002353	杰瑞股份	21,300	660,300.00	0.08

321	600642	申能股份	111,670	659,969.70	0.08
322	601198	东兴证券	60,500	659,450.00	0.08
323	603444	吉比特	1,200	658,812.00	0.08
324	002508	老板电器	21,080	655,798.80	0.08
325	600201	生物股份	23,500	654,240.00	0.08
326	600655	豫园股份	73,729	653,238.94	0.08
327	600426	华鲁恒升	36,872	651,896.96	0.08
328	000728	国元证券	77,600	651,840.00	0.08
329	002673	西部证券	79,832	651,429.12	0.08
330	002212	南洋股份	24,500	651,210.00	0.08
331	002074	国轩高科	24,000	644,160.00	0.08
332	300088	长信科技	56,800	636,160.00	0.08
333	002926	华西证券	59,800	635,674.00	0.08
334	601838	成都银行	79,700	634,412.00	0.08
335	600598	北大荒	39,400	634,340.00	0.08
336	600066	宇通客车	51,819	632,191.80	0.08
337	002939	长城证券	51,200	630,784.00	0.08
338	000999	华润三九	21,600	630,504.00	0.08
339	601998	中信银行	121,900	627,785.00	0.08
340	600170	上海建工	203,900	625,973.00	0.08
341	601689	拓普集团	22,300	622,170.00	0.08
342	601117	中国化学	111,900	613,212.00	0.08
343	600038	中直股份	14,900	611,943.00	0.08
344	002156	通富微电	24,400	611,220.00	0.08
345	300418	昆仑万维	24,300	606,528.00	0.08
346	600699	均胜电子	25,400	604,774.00	0.08
347	300070	碧水源	74,400	604,128.00	0.08
348	601878	浙商证券	60,900	603,519.00	0.08
349	002131	利欧股份	156,100	602,546.00	0.08
350	002683	宏大爆破	17,200	600,280.00	0.08
351	000671	阳光城	94,500	599,130.00	0.08
352	600068	葛洲坝	100,676	599,022.20	0.08
353	600362	江西铜业	44,464	598,485.44	0.08
354	000627	天茂集团	114,700	597,587.00	0.08
355	002468	申通快递	36,400	597,324.00	0.08
356	000723	美锦能源	95,300	596,578.00	0.08
357	002019	亿帆医药	25,800	592,626.00	0.08
358	000423	东阿阿胶	16,534	592,082.54	0.08
359	600875	东方电气	66,800	591,180.00	0.08
360	600369	西南证券	128,500	589,815.00	0.08
361	600208	新湖中宝	197,800	589,444.00	0.08
362	601992	金隅集团	192,202	588,138.12	0.08
363	600089	特变电工	86,410	584,995.70	0.08

364	000739	普洛药业	24,800	577,592.00	0.07
365	603605	珀莱雅	3,200	576,064.00	0.07
366	002399	海普瑞	22,600	565,904.00	0.07
367	002078	太阳纸业	59,200	563,584.00	0.07
368	002958	青农商行	126,800	561,724.00	0.07
369	600221	海航控股	374,200	561,300.00	0.07
370	002340	格林美	112,200	557,634.00	0.07
371	002281	光迅科技	16,900	555,334.00	0.07
372	600153	建发股份	68,335	553,513.50	0.07
373	002797	第一创业	79,800	552,216.00	0.07
374	000028	国药一致	12,200	549,122.00	0.07
375	002030	达安基因	20,020	546,145.60	0.07
376	300168	万达信息	24,745	546,122.15	0.07
377	600909	华安证券	79,900	545,717.00	0.07
378	600219	南山铝业	267,300	542,619.00	0.07
379	002396	星网锐捷	15,300	540,549.00	0.07
380	000750	国海证券	124,300	539,462.00	0.07
381	000401	冀东水泥	33,600	538,944.00	0.07
382	000988	华工科技	22,000	537,460.00	0.07
383	000998	隆平高科	32,200	536,130.00	0.07
384	300271	华宇软件	18,900	533,169.00	0.07
385	000540	中天金融	165,300	532,266.00	0.07
386	000932	华菱钢铁	140,400	529,308.00	0.07
387	600667	太极实业	44,700	528,354.00	0.07
388	002174	游族网络	20,200	526,816.00	0.07
389	600516	方大炭素	83,333	523,331.24	0.07
390	600027	华电国际	151,900	519,498.00	0.07
391	601233	桐昆股份	40,500	516,780.00	0.07
392	000709	河钢股份	252,023	514,126.92	0.07
393	000547	航天发展	37,600	513,992.00	0.07
394	600754	锦江酒店	18,400	510,600.00	0.07
395	600167	联美控股	35,300	506,202.00	0.07
396	300024	机器人	36,900	504,423.00	0.06
397	600704	物产中大	119,200	501,832.00	0.06
398	601099	太平洋	158,100	501,177.00	0.06
399	600026	中远海能	77,300	499,358.00	0.06
400	601966	玲珑轮胎	24,700	498,940.00	0.06
401	002572	索菲亚	20,600	497,902.00	0.06
402	600188	兖州煤业	56,800	497,568.00	0.06
403	601216	君正集团	195,100	495,554.00	0.06
404	002387	维信诺	33,900	484,092.00	0.06
405	600673	东阳光	70,000	483,700.00	0.06
406	300017	网宿科技	56,700	481,383.00	0.06

407	002081	金螳螂	60,755	477,534.30	0.06
408	000402	金融街	71,700	476,088.00	0.06
409	600688	上海石化	136,500	475,020.00	0.06
410	000630	铜陵有色	244,190	471,286.70	0.06
411	600977	中国电影	35,800	470,054.00	0.06
412	600566	济川药业	18,400	468,464.00	0.06
413	600460	士兰微	31,900	468,292.00	0.06
414	000686	东北证券	55,300	467,285.00	0.06
415	600372	中航电子	34,400	458,208.00	0.06
416	000729	燕京啤酒	66,700	456,895.00	0.06
417	601128	常熟银行	60,300	452,853.00	0.06
418	600160	巨化股份	65,200	449,228.00	0.06
419	000688	国城矿业	24,200	448,426.00	0.06
420	600583	海油工程	97,918	445,526.90	0.06
421	000825	太钢不锈	132,700	440,564.00	0.06
422	000415	渤海租赁	146,600	436,868.00	0.06
423	600733	北汽蓝谷	67,800	435,954.00	0.06
424	002372	伟星新材	37,100	431,473.00	0.06
425	600021	上海电力	58,300	431,420.00	0.06
426	601098	中南传媒	40,296	426,331.68	0.05
427	000027	深圳能源	91,770	425,812.80	0.05
428	002010	传化智联	75,800	412,352.00	0.05
429	002268	卫士通	19,300	411,862.00	0.05
430	600820	隧道股份	72,400	409,060.00	0.05
431	600256	广汇能源	150,600	406,620.00	0.05
432	000581	威孚高科	19,286	398,834.48	0.05
433	600549	厦门钨业	33,600	397,824.00	0.05
434	300026	红日药业	71,700	395,784.00	0.05
435	000629	攀钢钒钛	196,800	395,568.00	0.05
436	600967	内蒙一机	38,000	394,820.00	0.05
437	002500	山西证券	59,980	392,269.20	0.05
438	000089	深圳机场	50,900	389,894.00	0.05
439	000623	吉林敖东	24,600	386,958.00	0.05
440	600879	航天电子	60,000	386,400.00	0.05
441	002217	合力泰	73,500	385,875.00	0.05
442	600373	中文传媒	32,591	383,921.98	0.05
443	600675	中华企业	93,400	380,138.00	0.05
444	002563	森马服饰	53,900	379,995.00	0.05
445	002110	三钢闽光	57,000	379,620.00	0.05
446	300012	华测检测	19,200	379,392.00	0.05
447	600466	蓝光发展	70,100	377,839.00	0.05
448	002195	二三四五	133,935	376,357.35	0.05
449	000046	泛海控股	99,100	373,607.00	0.05

450	600446	金证股份	19,200	372,480.00	0.05
451	000883	湖北能源	105,400	371,008.00	0.05
452	601958	XD 金铂股	59,494	367,672.92	0.05
453	000997	新大陆	22,800	364,344.00	0.05
454	601699	潞安环能	65,060	362,384.20	0.05
455	000983	西山煤电	95,768	359,130.00	0.05
456	600808	马钢股份	138,965	358,529.70	0.05
457	300296	利亚德	58,500	355,095.00	0.05
458	600376	首开股份	58,800	344,568.00	0.04
459	000738	航发控制	24,800	338,520.00	0.04
460	603885	吉祥航空	37,200	338,520.00	0.04
461	601866	中远海发	183,000	336,720.00	0.04
462	000413	东旭光电	125,800	335,886.00	0.04
463	002085	万丰奥威	51,400	333,072.00	0.04
464	600572	康恩贝	59,600	327,800.00	0.04
465	600258	首旅酒店	21,300	327,381.00	0.04
466	000598	兴蓉环境	70,800	325,680.00	0.04
467	000031	大悦城	63,600	323,724.00	0.04
468	601598	中国外运	99,300	320,739.00	0.04
469	600056	中国医药	22,600	319,790.00	0.04
470	600863	内蒙华电	129,700	319,062.00	0.04
471	002506	协鑫集成	116,800	304,848.00	0.04
472	000898	鞍钢股份	121,536	297,763.20	0.04
473	600260	凯乐科技	21,500	290,680.00	0.04
474	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.02
475	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
476	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
477	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
478	688096	京源环保	4,485	96,068.70	0.01
479	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
480	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
481	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
482	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
483	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
484	300845	N 捷安	470	8,286.10	0.00
485	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
486	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00

注：报告期内“中信证券”系投资人申购交付组合证券被动持有。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	11,913,685.92	2.14
2	300750	宁德时代	7,373,176.82	1.33
3	300760	迈瑞医疗	7,187,502.00	1.29
4	002714	牧原股份	6,386,608.56	1.15
5	002415	海康威视	5,718,073.85	1.03
6	000001	平安银行	5,607,652.06	1.01
7	000002	万 科 A	5,388,851.60	0.97
8	002475	立讯精密	5,227,612.82	0.94
9	000651	格力电器	3,814,608.40	0.69
10	600519	贵州茅台	3,787,125.05	0.68
11	002352	顺丰控股	3,744,401.00	0.67
12	000063	中兴通讯	3,715,756.80	0.67
13	002916	深南电路	3,350,039.32	0.60
14	002304	洋河股份	3,322,345.04	0.60
15	000661	长春高新	3,317,619.04	0.60
16	300454	深信服	3,185,060.00	0.57
17	300015	爱尔眼科	3,168,938.10	0.57
18	300498	温氏股份	3,093,534.80	0.56
19	300122	智飞生物	3,039,122.87	0.55
20	002142	宁波银行	3,030,420.49	0.54

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。

7.4.2 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	8,417,182.92	1.51
2	300750	宁德时代	5,234,705.00	0.94
3	002415	海康威视	4,700,409.00	0.85
4	000002	万 科 A	4,270,958.20	0.77
5	000001	平安银行	3,981,228.41	0.72
6	002714	牧原股份	3,847,414.08	0.69
7	000333	美的集团	3,779,364.97	0.68
8	002475	立讯精密	3,629,190.00	0.65
9	300760	迈瑞医疗	3,290,000.00	0.59
10	000651	格力电器	2,949,079.75	0.53
11	000063	中兴通讯	2,689,614.00	0.48
12	300498	温氏股份	2,567,569.78	0.46
13	002916	深南电路	2,554,230.00	0.46
14	002304	洋河股份	2,489,691.25	0.45
15	001979	招商蛇口	2,485,596.33	0.45

16	300454	深信服	2,372,295.00	0.43
17	000725	京东方 A	2,332,655.00	0.42
18	300015	爱尔眼科	2,208,776.65	0.40
19	002142	宁波银行	2,201,948.95	0.40
20	600887	伊利股份	2,192,421.52	0.39

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	358,661,466.90
卖出股票的收入（成交）总额	244,648,208.92

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。

7.5 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）	88,300.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	88,300.00	0.01

7.6 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	128112	歌尔转 2	636	63,600.00	0.01
2	128114	正邦转债	247	24,700.00	0.00
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2007	沪深 300 股指期货 IF2007 合约	6	7,412,400.00	305,580.00	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。
IF2009	沪深 300 股指期货 IF2009 合约	6	7,321,680.00	174,060.00	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。
IF2008	沪深 300 股指期货 IF2008 合约	5	6,122,700.00	43,620.00	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。
IC2007	中证 500 股指期货 IC2007 合约	4	4,639,520.00	133,400.00	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。
IC2008	中证 500 股指期货 IC2008 合约	1	1,146,000.00	16,680.00	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					673,340.00
股指期货投资本期收益					316,291.26
股指期货投资本期公允价值变动					376,840.00

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,849,706.22
2	应收证券清算款	18,457,989.23
3	应收股利	2,500.00
4	应收利息	6,778.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,316,974.22

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	华夏 MSCI 中国 A 股国

	额					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
4,394	128,929.32	85,933,959.00	15.17%	141,382,178.00	24.96%	339,199,281.00	59.87%

8.2 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	友邦保险有限公司上海分公司—传统—普通保险产品	14,793,100.00	2.61%
2	友邦保险有限公司江苏分公司—传统—普通保险产品	14,573,100.00	2.57%
3	竞技世界（北京）网络技术有限公司	12,095,100.00	2.13%
4	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	1.94%
5	广发证券股份有限公司	7,526,119.00	1.33%
6	华泰证券股份有限公司	6,256,400.00	1.10%
7	粤开证券股份有限公司	5,826,437.00	1.03%
8	安英慧	5,038,800.00	0.89%
9	生命保险资管—农业银行—生命资产价值精选资产管理产品	4,100,000.00	0.72%
10	古春辉	3,146,400.00	0.56%
11	中国银行股份有限公司—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	339,199,281.00	59.87%

8.3 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	-	-

8.4 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的情况

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
-----------------	---

§9 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	442,621,733.00
本报告期基金总申购份额	480,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	356,106,315.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	566,515,418.00

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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 2020 年 4 月 1 日发布公告，张德根先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关责令改正的行政监管措施，公司已按要求改正并报告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
方正证券	4	358,598,236.71	60.41%	154,666.28	60.41%	-
广发证券	1	121,318,236.12	20.44%	52,324.91	20.44%	-
华泰证券	4	48,128,369.88	8.11%	20,758.00	8.11%	-
海通证券	4	45,495,667.37	7.66%	19,621.67	7.66%	-
中信证券	10	17,314,662.35	2.92%	7,468.44	2.92%	-
中金公司	4	2,711,905.55	0.46%	1,169.76	0.46%	-

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、东海证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、华西证券、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、野村东方国际证券、粤开证券、招商证券、中国银河证券、中金公司、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，国盛证券、海通证券、招商证券、中信建投证券、中信证券、中银国际证券的部分交易单元、东海证券、东兴证券、广发证券、华西证券、野村东方国际证券、粤开证券的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。

10.7.2 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
方正证券	290,978.40	24.80%	5,000,000.00	100.00%
广发证券	-	-	-	-
华泰证券	66,993.01	5.71%	-	-
海通证券	8,861.30	0.76%	-	-
中信证券	103,934.14	8.86%	-	-
中金公司	702,327.29	59.87%	-	-

10.8 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修订旗下上海证券交易所跨市场股票 ETF 基金合同、招募说明书的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-15
2	华夏基金管理有限公司关于根据国家延长春节假期通知及交易所休市安排等调整旗下基金春节后业务办理日期的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-30
3	华夏基金管理有限公司关于旗下上交所上市基金新增启用扩位证券简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-13
4	关于华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-24
5	关于华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金恢复申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
6	华夏基金管理有限公司关于旗下公募基金 2019 年年报延缓审计与披露的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-26
7	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-01
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过 20% 的时间区 间					
华夏 MSCI 中国 A 股 国际 通 ETF 联接	1	2020-01-01 至 2020-06-30	197,307,581.00	169,291,700.00	27,400,000.00	339,199,281.00	59.87%
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>							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金转型的文件；
- 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》；
- 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》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇二〇年八月二十九日