

**华夏中证央企结构调整交易型开放式指数
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
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.....	50
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	华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证央企 ETF
场内简称	央企改革（扩位证券简称：央企改革 ETF）
基金主代码	512950
交易代码	512950
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 10 月 19 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	13,579,550,969.00 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
上市日期	2019 年 1 月 18 日

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。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即中证央企结构调整指数收益率。
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	贺倩
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	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

§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	-73,123,426.75
本期利润	-713,156,783.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0537
本期加权平均净值利润率	-5.68%
本期基金份额净值增长率	-6.29%
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	-791,096,634.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0583
期末基金资产净值	12,788,454,334.05
期末基金份额净值	0.9417
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	-5.83%

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	4.85%	0.88%	4.13%	0.90%	0.72%	-0.02%
过去三个月	4.87%	0.94%	3.72%	0.95%	1.15%	-0.01%
过去六个月	-6.29%	1.49%	-7.33%	1.49%	1.04%	0.00%

过去一年	-4.96%	1.21%	-6.97%	1.22%	2.01%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-5.83%	1.25%	8.98%	1.32%	-14.81%	-0.07%

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

华夏中证央企结构调整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 10 月 19 日至 2020 年 6 月 30 日)



§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		
庞亚平	本基金的基金经理、数量投资部总监	2018-10-19	-	11 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。
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2018-10-19	-	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，本基金出现 1 次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，为本基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证央企结构调整指数，中证央企结构调整指数以国资委下辖央企上市公司为待选样本，综合评估其在产业结构调整、科技创新投入、国际业务发展等方面的情况，以此选取其中较具代表性的企业股票构成指数，反映央企结构调整板块在 A 股市场的整体走势。截至 2020 年 6 月 30 日，中证央企结构调整指数成份股 100 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。

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 录得自统计以来新低 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 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中国银河证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中信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 0.9417 元，本报告期份额净值增长率为-6.29%，同期业绩比较基准增长率-7.33%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.04%，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

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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中期报告中的财务指标、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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§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：华夏中证央企结构调整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	28,128,010.04	10,237,303.84
结算备付金		117,439,509.71	178,823,985.02
存出保证金		15,702,589.51	19,967,948.77
交易性金融资产	6.4.7.2	12,633,050,170.80	12,956,718,572.57
其中：股票投资		12,633,050,170.80	12,952,571,772.57
基金投资		-	-
债券投资		-	4,146,800.00
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		690,147.77	453,619.60
应收利息	6.4.7.5	171,519.05	239,350.09
应收股利		220,503.87	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,795,402,450.75	13,166,440,779.89
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		472,433.23	446,058.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,541,973.25	1,625,517.76
应付托管费		513,991.10	541,839.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,218,633.04	1,382,630.26
应交税费		7,317.06	293,052.31
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,193,769.02	1,163,085.67
负债合计		6,948,116.70	5,452,183.24
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	13,579,550,969.00	13,096,550,969.00
未分配利润	6.4.7.10	-791,096,634.95	64,437,627.65
所有者权益合计		12,788,454,334.05	13,160,988,596.65
负债和所有者权益总计		12,795,402,450.75	13,166,440,779.89

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9417 元，基金份额总额 13,579,550,969.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证央企结构调整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		-690,758,464.51	1,145,840,980.68
1.利息收入		3,204,429.21	6,426,748.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,589,972.05	6,101,804.83
债券利息收入		424.82	1,525.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,098.63	323,418.32
证券出借利息收入		1,610,933.71	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-56,805,328.88	-165,945,755.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-182,714,357.00	-302,612,195.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,021,766.72	558,330.29
资产支持证券投资	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	351,582.39	-5,630,380.00
股利收益	6.4.7.17	124,535,679.01	141,738,490.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-640,033,357.22	1,304,833,790.34
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	2,875,792.38	526,196.90
减：二、费用		22,398,319.46	31,275,871.19
1.管理人报酬		9,364,315.85	11,872,555.07
2.托管费		3,121,438.66	3,957,518.33
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	8,042,167.75	13,201,495.18
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		7,226.03	4.55
7.其他费用	6.4.7.21	1,863,171.17	2,244,298.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-713,156,783.97	1,114,565,109.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-713,156,783.97	1,114,565,109.49

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证央企结构调整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）	13,096,550,969.00	64,437,627.65	13,160,988,596.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-713,156,783.97	-713,156,783.97
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）	483,000,000.00	-142,377,478.63	340,622,521.37
其中：1.基金申购款	2,071,000,000.00	-172,607,140.04	1,898,392,859.96
2.基金赎回款	-1,588,000,000.00	30,229,661.41	-1,557,770,338.59
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）	13,579,550,969.00	-791,096,634.95	12,788,454,334.05
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）	15,887,550,969.00	-1,234,418,358.32	14,653,132,610.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,114,565,109.49	1,114,565,109.49
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）	-44,000,000.00	-25,668,966.12	-69,668,966.12
其中：1.基金申购款	848,000,000.00	8,891,857.63	856,891,857.63
2.基金赎回款	-892,000,000.00	-34,560,823.75	-926,560,823.75
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）	15,843,550,969.00	-145,522,214.95	15,698,028,754.05

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

华夏中证央企结构调整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[2018]949号《关于准予华夏中证央企结构调整交易型开放式指数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》、《华夏中证央企结构调整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 2018 年 8 月 27 日至 2018 年 10 月 12 日共募集 15,887,305,303.00 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（2018）验字第 60739337_A30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 10 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 15,887,550,969.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 245,666.00 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。

为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）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的相关规定）。

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	28,128,010.04
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	28,128,010.04

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	12,983,987,012.34	12,633,050,170.80	-350,936,841.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	12,983,987,012.34	12,633,050,170.80	-350,936,841.54

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	138,819,720.00	-	-	-
其中：股指期货	138,819,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	138,819,720.00	-	-	-

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	46	56,828,400.00	2,551,920.00	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	29	33,636,520.00	1,051,840.00	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。
IH2007	上证 50 股指 期货 IH2007 合约	27	23,535,360.00	728,040.00	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	15	18,304,200.00	392,340.00	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	-37,800.00	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。
IH2009	上证 50 股指 期货 IH2009	6	5,170,680.00	91,800.00	买入股指期货合约的 目的是进行更有效地

	合约				流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计					4,778,140.00
股指期货投资本期收益					351,582.39
股指期货投资本期公允价值变动					1,958,840.00

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	5,466.75
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	68,733.42
应收债券利息	-
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	97,017.28
其他	301.60
合计	171,519.05

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	3,218,633.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,218,633.04

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	104,426.14
应付指数使用费	869,930.79
应退替代款	217,521.49
可退替代款	1,890.60
合计	1,193,769.02

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	13,096,550,969.00	13,096,550,969.00
本期申购	2,071,000,000.00	2,071,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,588,000,000.00	-1,588,000,000.00
本期末	13,579,550,969.00	13,579,550,969.00

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	-142,961,497.75	207,399,125.40	64,437,627.65
本期利润	-73,123,426.75	-640,033,357.22	-713,156,783.97
本期基金份额交易产生的变动数	-5,309,168.70	-137,068,309.93	-142,377,478.63
其中：基金申购款	-17,960,548.03	-154,646,592.01	-172,607,140.04
基金赎回款	12,651,379.33	17,578,282.08	30,229,661.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-221,394,093.20	-569,702,541.75	-791,096,634.95

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	131,245.71
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	1,454,537.32
其他	4,189.02
合计	1,589,972.05

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	-123,138,014.18
股票投资收益——赎回差价收入	-59,576,342.82
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	-182,714,357.00

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	3,843,227,427.79
减：卖出股票成本总额	3,966,365,441.97
买卖股票差价收入	-123,138,014.18

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	1,557,770,338.59
减：现金支付赎回款总额	409,124,406.59
减：赎回股票成本总额	1,208,222,274.82
赎回差价收入	-59,576,342.82

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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	5,169,287.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,146,800.00

减：应收利息总额	720.99
买卖债券差价收入	1,021,766.72

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	351,582.39
合计	351,582.39

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	124,535,679.01
其中：证券出借权益补偿收入	405,929.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	124,535,679.01

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	-641,992,197.22
——股票投资	-641,992,197.22
——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	1,958,840.00
——权证投资	-
——期货投资	1,958,840.00
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	-640,033,357.22

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	-
替代损益	2,875,792.38
合计	2,875,792.38

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	8,042,167.75
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	8,042,167.75

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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	12,501.86
指数使用费	1,745,843.17

其他	400.00
合计	1,863,171.17

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏中证央企 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	55,346,793.36	0.70%	5,018,836,549.64	36.58%

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

		券成交总 额的比例		成交总额的 比例
中信证券	-	-	4,777,268.06	80.12%

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	23,871.29	0.70%	23,871.29	0.74%
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	2,089,833.66	35.77%	1,845,924.79	50.92%

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	9,364,315.85	11,872,555.07
其中：支付销售机构的客户维护费	991.67	-

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 0.15% 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×0.15%/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	3,121,438.66	3,957,518.33

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 0.05%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×0.05%/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	292,250,416.00	264,812.57	91,606,539.00	25,193.78

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
华夏中证央企 ETF 联接	260,615,250.00	1.92%	285,465,250.00	2.18%
中信证券	2,220,948.00	0.02%	2,869,703.00	0.02%

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
中国农业银行活期存款	28,128,010.04	131,245.71	41,990,578.38	1,078,843.88

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
中信证券	000901	航天科技	配股	613,582	4,276,666.54
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
中信证券	-	-	-	-	-

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

无。

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
688158	优刻得	2020-01-10	2020-07-20	新发流	33.23	68.38	20,700	687,861.00	1,415,466.00	-

				通受限						
688200	华峰测控	2020-02-11	2020-08-18	新发流通受限	107.41	270.02	3,780	406,009.80	1,020,675.60	-
688298	东方生物	2020-01-20	2020-08-05	新发流通受限	21.25	144.17	5,286	112,327.50	762,082.62	-
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	-
688159	有方科技	2020-01-16	2020-07-23	新发流通受限	20.35	52.73	3,341	67,989.35	176,170.93	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新发流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
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	-

				限						
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	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新发流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
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	-

6.4.12.2 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	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
2020061100000332	600118	中国卫星	2020-06-11	2020-07-09	30.83	250,000.00	7,707,500.00
2020061100000345	600118	中国卫星	2020-06-11	2020-07-09	30.83	20,000.00	616,600.00
2020061100000366	600312	平高电气	2020-06-11	2020-07-09	7.42	20,000.00	148,400.00
2020061100000367	600312	平高电气	2020-06-11	2020-07-09	7.42	200,000.00	1,484,000.00
2020061100000368	600312	平高电气	2020-06-11	2020-07-09	7.42	50,000.00	371,000.00
2020061100000369	600845	宝信软件	2020-06-11	2020-07-09	59.08	10,000.00	590,800.00
2020061100000396	601179	中国西电	2020-06-11	2020-07-09	4.84	60,000.00	290,400.00
2020061100000401	601179	中国西电	2020-06-11	2020-07-09	4.84	600,000.00	2,904,000.00
2020061100000404	601179	中国西电	2020-06-11	2020-07-09	4.84	100,000.00	484,000.00

2020061100000406	601179	中国西电	2020-06-11	2020-07-09	4.84	380,000.00	1,839,200.00
2020061100000408	601179	中国西电	2020-06-11	2020-07-09	4.84	70,000.00	338,800.00
2020061100000420	600776	东方通信	2020-06-11	2020-07-09	15.09	40,000.00	603,600.00
2020061100000431	600536	中国软件	2020-06-11	2020-07-09	79.20	10,000.00	792,000.00
2020061100000442	600536	中国软件	2020-06-11	2020-07-09	79.20	10,000.00	792,000.00
2020061100000456	600498	烽火通信	2020-06-11	2020-07-09	28.91	10,000.00	289,100.00
2020061800000554	600118	中国卫星	2020-06-18	2020-07-16	30.83	20,000.00	616,600.00
2020061800000581	600161	天坛生物	2020-06-18	2020-07-02	45.33	12,800.00	580,224.00
2020061800000635	600737	中粮糖业	2020-06-18	2020-07-16	7.78	115,100.00	895,478.00
2020061800000641	600312	平高电气	2020-06-18	2020-07-16	7.42	30,000.00	222,600.00
2020061800000643	601872	招商轮船	2020-06-18	2020-07-16	5.83	520,000.00	3,031,600.00

2020061800000669	600050	中国联通	2020-06-18	2020-07-02	4.84	159,300.00	771,012.00
2020061800000676	601857	中国石油	2020-06-18	2020-07-02	4.19	235,300.00	985,907.00
2020061800000679	600026	中远海能	2020-06-18	2020-07-16	6.46	457,000.00	2,952,220.00
2020061800000682	600026	中远海能	2020-06-18	2020-07-16	6.46	20,000.00	129,200.00
2020061800000698	600500	中化国际	2020-06-18	2020-07-16	5.06	30,000.00	151,800.00
2020061800000710	601179	中国西电	2020-06-18	2020-07-16	4.84	120,000.00	580,800.00
2020061800000715	601179	中国西电	2020-06-18	2020-07-16	4.84	100,000.00	484,000.00
2020061800000719	601179	中国西电	2020-06-18	2020-07-16	4.84	370,000.00	1,790,800.00
2020061800000743	600482	中国动力	2020-06-18	2020-07-02	15.70	55,600.00	872,920.00
2020061800000760	600776	东方通信	2020-06-18	2020-07-16	15.09	25,000.00	377,250.00
2020061800000768	600776	东方通信	2020-06-18	2020-07-16	15.09	40,000.00	603,600.00

2020061800000832	600498	烽火通信	2020-06-18	2020-07-16	28.91	17,000.00	491,470.00
2020061800000892	600517	国网英大	2020-06-18	2020-07-16	6.68	180,000.00	1,202,400.00
2020061800000896	600517	国网英大	2020-06-18	2020-07-16	6.68	447,000.00	2,985,960.00
2020061800000900	600150	中国船舶	2020-06-18	2020-07-16	17.44	166,000.00	2,895,040.00
2020061800000921	600489	中金黄金	2020-06-18	2020-07-02	9.14	11,600.00	106,024.00
2020061800000974	600688	上海石化	2020-06-18	2020-07-16	3.48	850,000.00	2,958,000.00
2020061800000994	600339	中油工程	2020-06-18	2020-07-02	2.27	391,900.00	889,613.00
2020061800001005	600339	中油工程	2020-06-18	2020-07-02	2.27	264,300.00	599,961.00
2020062300000553	600118	中国卫星	2020-06-23	2020-07-21	30.83	61,000.00	1,880,630.00
2020062300000558	600795	国电电力	2020-06-23	2020-07-21	1.85	93,900.00	173,715.00
2020062300000578	600582	天地科技	2020-06-23	2020-07-21	2.93	169,000.00	495,170.00

2020062300000587	600029	南方航空	2020-06-23	2020-07-21	5.17	35,100.00	181,467.00
2020062300000600	600068	葛洲坝	2020-06-23	2020-07-21	5.95	83,000.00	493,850.00
2020062300000606	600312	平高电气	2020-06-23	2020-07-21	7.42	19,400.00	143,948.00
2020062300000612	601872	招商轮船	2020-06-23	2020-07-21	5.83	20,000.00	116,600.00
2020062300000620	601800	中国交建	2020-06-23	2020-07-21	7.34	64,000.00	469,760.00
2020062300000633	600845	宝信软件	2020-06-23	2020-07-21	59.08	17,000.00	1,004,360.00
2020062300000680	600536	中国软件	2020-06-23	2020-07-21	79.20	30,000.00	2,376,000.00
2020062300000686	601179	中国西电	2020-06-23	2020-07-21	4.84	210,000.00	1,016,400.00
2020062300000688	600498	烽火通信	2020-06-23	2020-07-21	28.91	20,000.00	578,200.00
2020062300000704	601179	中国西电	2020-06-23	2020-07-21	4.84	100,000.00	484,000.00
2020062300000705	600498	烽火通信	2020-06-23	2020-07-21	28.91	33,000.00	954,030.00
2020062300000713	601179	中	2020-06-23	2020-07-07	4.84	128,500.00	621,940.00

		国 西 电					
2020062300000714	600115	东 方 航 空	2020-06-23	2020-07-07	4.22	136,300.00	575,186.00
2020062300000716	600776	东 方 通 信	2020-06-23	2020-07-21	15.09	40,000.00	603,600.00
2020062300000731	600776	东 方 通 信	2020-06-23	2020-07-21	15.09	21,000.00	316,890.00
2020062300000733	600776	东 方 通 信	2020-06-23	2020-07-07	15.09	70,000.00	1,056,300.00
2020062300000746	600536	中 国 软 件	2020-06-23	2020-07-07	79.20	15,000.00	1,188,000.00
2020062300000792	601872	招 商 轮 船	2020-06-23	2020-07-07	5.83	10,000.00	58,300.00
2020062900003610	600026	中 远 海 能	2020-06-29	2020-07-13	6.46	84,300.00	544,578.00
2020062900003616	600118	中 国 卫 星	2020-06-29	2020-07-13	30.83	17,800.00	548,774.00
2020062900003618	601179	中 国 西 电	2020-06-29	2020-07-13	4.84	115,700.00	559,988.00
2020062900003620	600776	东 方 通 信	2020-06-29	2020-07-13	15.09	60,000.00	905,400.00
2020062900003622	600312	平	2020-06-29	2020-07-13	7.42	77,000.00	571,340.00

		高电气					
2020062900003632	600536	中国软件	2020-06-29	2020-07-13	79.20	10,000.00	792,000.00
2020063000008212	600536	中国软件	2020-06-30	2020-07-14	79.20	11,500.00	910,800.00
2020061100000096	000066	中国长城	2020-06-11	2020-07-09	13.20	100,000.00	1,320,000.00
2020061100000099	000066	中国长城	2020-06-11	2020-07-09	13.20	300,000.00	3,960,000.00
2020061100000100	000066	中国长城	2020-06-11	2020-07-09	13.20	100,000.00	1,320,000.00
2020061100000103	000423	东阿阿胶	2020-06-11	2020-07-09	35.81	10,000.00	358,100.00
2020061100000108	000066	中国长城	2020-06-11	2020-07-09	13.20	60,000.00	792,000.00
2020061100000151	000969	安泰科技	2020-06-11	2020-07-09	6.60	200,000.00	1,320,000.00
2020061100000221	002405	四维图新	2020-06-11	2020-07-09	16.49	40,000.00	659,600.00
2020061100000245	002916	深南电路	2020-06-11	2020-07-09	167.52	10,000.00	1,675,200.00
2020061100000250	002916	深	2020-06-11	2020-07-09	167.52	100,000.00	16,752,000.00

		南 电 路					
2020061100000322	300747	锐 科 激 光	2020-06-11	2020-07-09	108.83	10,000.00	1,088,300.00
2020061800000545	300747	锐 科 激 光	2020-06-18	2020-07-16	108.83	30,000.00	3,264,900.00
2020061800000140	000066	中 国 长 城	2020-06-18	2020-07-16	13.20	60,000.00	792,000.00
2020061800000147	000423	东 阿 阿 胶	2020-06-18	2020-07-16	35.81	85,000.00	3,043,850.00
2020061800000161	000550	江 铃 汽 车	2020-06-18	2020-07-16	12.37	60,000.00	742,200.00
2020061800000164	000591	太 阳 能	2020-06-18	2020-07-16	3.38	912,000.00	3,082,560.00
2020061800000203	000901	航 天 科 技	2020-06-18	2020-07-02	10.19	35,200.00	358,688.00
2020061800000206	000901	航 天 科 技	2020-06-18	2020-07-16	10.19	296,000.00	3,016,240.00
2020061800000214	000969	安 泰 科 技	2020-06-18	2020-07-16	6.60	478,000.00	3,154,800.00
2020061800000233	002025	航 天 电 器	2020-06-18	2020-07-16	36.58	101,000.00	3,694,580.00
2020061800000255	002051	中 工	2020-06-18	2020-07-02	7.28	119,400.00	869,232.00

		国际					
2020061800000257	002051	中工国际	2020-06-18	2020-07-16	7.28	100,000.00	728,000.00
2020061800000261	002051	中工国际	2020-06-18	2020-07-02	7.28	69,800.00	508,144.00
2020061800000263	002106	莱宝高科	2020-06-18	2020-07-16	13.14	248,000.00	3,258,720.00
2020061800000325	002268	卫士通	2020-06-18	2020-07-16	21.34	140,000.00	2,987,600.00
2020061800000348	002405	四维图新	2020-06-18	2020-07-02	16.49	55,700.00	918,493.00
2020061800000397	002643	万润股份	2020-06-18	2020-07-16	17.17	183,000.00	3,142,110.00
2020061800000427	002916	深南电路	2020-06-18	2020-07-16	167.52	10,000.00	1,675,200.00
2020061800000428	002916	深南电路	2020-06-18	2020-07-02	167.52	30,000.00	5,025,600.00
2020061800000495	300188	美亚柏科	2020-06-18	2020-07-16	19.83	145,000.00	2,875,350.00
2020062300000186	000550	江铃汽车	2020-06-23	2020-07-07	12.37	45,700.00	565,309.00
2020062300000213	000786	北新建材	2020-06-23	2020-07-21	21.33	75,400.00	1,608,282.00

		材					
2020062300000227	000901	航 天 科 技	2020-06-23	2020-07-07	10.19	238,400.00	2,429,296.00
2020062300000259	002051	中 工 国 际	2020-06-23	2020-07-07	7.28	108,700.00	791,336.00
2020062300000302	002405	四 维 图 新	2020-06-23	2020-07-21	16.49	75,000.00	1,236,750.00
2020062300000303	002405	四 维 图 新	2020-06-23	2020-07-21	16.49	10,000.00	164,900.00
2020062300000318	002916	深 南 电 路	2020-06-23	2020-07-21	167.52	10,000.00	1,675,200.00
2020062300000321	002916	深 南 电 路	2020-06-23	2020-07-21	167.52	10,000.00	1,675,200.00
2020062300000322	002916	深 南 电 路	2020-06-23	2020-07-21	167.52	10,000.00	1,675,200.00
2020062300000323	002916	深 南 电 路	2020-06-23	2020-07-21	167.52	20,000.00	3,350,400.00
2020062900003424	000151	中 成 股 份	2020-06-29	2020-07-13	8.66	89,000.00	770,740.00
2020062900003630	000066	中 国 长 城	2020-06-29	2020-07-13	13.20	157,200.00	2,075,040.00
2020062900003634	002405	四 维 图	2020-06-29	2020-07-13	16.49	73,100.00	1,205,419.00

		新					
合计						13,231,000.00	157,653,644.00

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	12,633,050,170.80	98.78	12,952,571,772.57	98.42
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	4,146,800.00	0.03
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	12,633,050,170.80	98.78	12,956,718,572.57	98.45

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	除中证央企结构调整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%	660,241,150.18	642,120,081.64
	-5%	-660,241,150.18	-642,120,081.64

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 12,629,670,271.65 元，第二层次的余额为 3,374,395.15 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 12,953,981,189.00 元，第二层次的余额为 2,737,383.57 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	12,633,050,170.80	98.73
	其中:股票	12,633,050,170.80	98.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	145,567,519.75	1.14
8	其他各项资产	16,784,760.20	0.13
9	合计	12,795,402,450.75	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 157,653,644.00 元,占本基金期末资产净值的 1.23%。

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	-	-
B	采矿业	881,644,610.35	6.89
C	制造业	5,705,331,510.93	44.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	974,191,504.24	7.62
E	建筑业	1,189,176,771.82	9.30
F	批发和零售业	6,888,164.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	443,730,726.10	3.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,588,967,717.69	12.43
J	金融业	703,279,962.90	5.50
K	房地产业	601,211,582.82	4.70
L	租赁和商务服务业	538,622,115.95	4.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,633,044,666.80	98.78

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	002415	海康威视	21,072,371	639,546,459.85	5.00
2	601888	中国中免	3,496,865	538,622,115.95	4.21
3	600900	长江电力	20,756,583	393,129,682.02	3.07
4	600406	国电南瑞	19,340,443	391,643,970.75	3.06
5	000063	中兴通讯	9,541,000	382,880,330.00	2.99
6	600048	保利地产	24,905,247	368,099,550.66	2.88
7	600036	招商银行	10,410,300	351,035,316.00	2.74
8	601668	中国建筑	69,623,487	332,104,032.99	2.60
9	601766	中国中车	54,484,750	303,480,057.50	2.37
10	600999	招商证券	12,807,422	281,122,912.90	2.20
11	002202	金风科技	24,735,900	246,616,923.00	1.93
12	002230	科大讯飞	6,564,783	245,719,827.69	1.92
13	600028	中国石化	59,923,300	234,300,103.00	1.83
14	001979	招商蛇口	14,179,564	233,112,032.16	1.82
15	002405	四维图新	13,391,925	220,832,843.25	1.73
16	002916	深南电路	1,276,863	213,900,089.76	1.67
17	601088	中国神华	14,773,320	212,144,875.20	1.66
18	002179	中航光电	4,930,955	202,218,464.55	1.58

19	600050	中国联通	41,691,000	201,784,440.00	1.58
20	000066	中国长城	14,993,456	197,913,619.20	1.55
21	000625	长安汽车	17,471,800	192,189,800.00	1.50
22	600893	航发动力	8,061,958	189,294,773.84	1.48
23	601857	中国石油	43,516,823	182,335,488.37	1.43
24	600498	烽火通信	6,293,976	181,958,846.16	1.42
25	600019	宝钢股份	39,903,075	181,958,022.00	1.42
26	601390	中国中铁	34,002,633	170,693,217.66	1.33
27	601989	中国重工	40,853,918	163,415,672.00	1.28
28	000786	北新建材	7,567,742	161,419,936.86	1.26
29	601186	中国铁建	19,207,808	160,961,431.04	1.26
30	600271	航天信息	9,536,901	154,879,272.24	1.21
31	000423	东阿阿胶	4,101,318	146,868,197.58	1.15
32	000050	深天马 A	9,173,929	140,911,549.44	1.10
33	600068	葛洲坝	23,066,810	137,247,519.50	1.07
34	002281	光迅科技	3,639,014	119,578,000.04	0.94
35	601985	中国核电	27,888,402	114,063,564.18	0.89
36	601669	中国电建	31,932,530	110,486,553.80	0.86
37	601800	中国交建	14,711,400	107,981,676.00	0.84
38	002268	卫士通	5,007,941	106,869,460.94	0.84
39	600161	天坛生物	2,341,193	106,126,278.69	0.83
40	600029	南方航空	19,805,627	102,395,091.59	0.80
41	000999	华润三九	3,507,654	102,388,420.26	0.80
42	600536	中国软件	1,266,156	100,279,555.20	0.78
43	600795	国电电力	52,810,944	97,700,246.40	0.76
44	600886	国投电力	12,158,353	95,564,654.58	0.75
45	300747	锐科激光	859,912	93,584,222.96	0.73
46	002080	中材科技	6,013,375	93,207,312.50	0.73
47	600583	海油工程	19,804,245	90,109,314.75	0.70
48	601179	中国西电	18,368,000	88,901,120.00	0.70
49	601111	中国国航	13,386,689	88,486,014.29	0.69
50	600176	中国巨石	9,412,467	86,124,073.05	0.67
51	600115	东方航空	20,071,891	84,703,380.02	0.66
52	002025	航天电器	2,305,800	84,346,164.00	0.66
53	002643	万润股份	4,886,506	83,901,308.02	0.66
54	600011	华能国际	19,704,467	83,152,850.74	0.65
55	300188	美亚柏科	4,122,960	81,758,296.80	0.64
56	600118	中国卫星	2,648,293	81,646,873.19	0.64
57	601600	中国铝业	29,291,200	80,843,712.00	0.63
58	003816	中国广核	26,428,500	78,228,360.00	0.61
59	600489	中金黄金	8,318,060	76,027,068.40	0.59
60	601919	中远海控	21,676,930	75,218,947.10	0.59
61	601618	中国中冶	29,809,817	74,822,640.67	0.59

62	002063	远光软件	5,792,600	73,160,538.00	0.57
63	000400	许继电气	5,419,800	71,541,360.00	0.56
64	600390	五矿资本	10,073,900	71,121,734.00	0.56
65	601808	中海油服	5,304,191	69,697,069.74	0.54
66	002106	莱宝高科	5,058,300	66,466,062.00	0.52
67	600150	中国船舶	3,782,200	65,961,568.00	0.52
68	600845	宝信软件	1,098,526	64,900,916.08	0.51
69	601698	中国卫通	3,583,268	64,534,656.68	0.50
70	600760	中航沈飞	1,881,900	61,763,958.00	0.48
71	600312	平高电气	7,293,608	54,118,571.36	0.42
72	601872	招商轮船	9,057,280	52,803,942.40	0.41
73	600528	中铁工业	5,970,500	52,659,810.00	0.41
74	600027	华电国际	14,594,800	49,914,216.00	0.39
75	000901	航天科技	4,636,553	47,246,475.07	0.37
76	600970	中材国际	8,714,200	46,010,976.00	0.36
77	600482	中国动力	2,903,500	45,584,950.00	0.36
78	600875	东方电气	4,978,600	44,060,610.00	0.34
79	600582	天地科技	14,830,040	43,452,017.20	0.34
80	000969	安泰科技	6,433,900	42,463,740.00	0.33
81	600026	中远海能	6,211,045	40,123,350.70	0.31
82	600737	中粮糖业	4,790,300	37,268,534.00	0.29
83	300455	康拓红外	2,450,100	36,383,985.00	0.28
84	000503	国新健康	3,220,900	35,880,826.00	0.28
85	000039	中集集团	4,774,271	34,517,979.33	0.27
86	600688	上海石化	9,848,223	34,271,816.04	0.27
87	600517	国网英大	5,122,400	34,217,632.00	0.27
88	601869	长飞光纤	1,092,000	33,644,520.00	0.26
89	601718	际华集团	9,835,561	32,654,062.52	0.26
90	600776	东方通信	2,141,000	32,307,690.00	0.25
91	000591	太阳能	9,428,600	31,868,668.00	0.25
92	600372	中航电子	2,364,300	31,492,476.00	0.25
93	600500	中化国际	6,183,950	31,290,787.00	0.24
94	600025	华能水电	8,062,400	30,556,496.00	0.24
95	002051	中工国际	4,132,347	30,083,486.16	0.24
96	000898	鞍钢股份	10,741,581	26,316,873.45	0.21
97	000550	江铃汽车	1,860,600	23,015,622.00	0.18
98	000065	北方国际	2,569,800	18,785,238.00	0.15
99	600339	中油工程	7,502,507	17,030,690.89	0.13
100	000151	中成股份	795,400	6,888,164.00	0.05
101	688158	优刻得	20,700	1,415,466.00	0.01
102	688200	华峰测控	3,780	1,020,675.60	0.01
103	688298	东方生物	5,286	762,082.62	0.01
104	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00

105	688159	有方科技	3,341	176,170.93	0.00
106	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
107	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
108	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
109	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
110	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
111	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
112	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
113	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
114	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
115	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
116	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
117	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00

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	000063	中兴通讯	365,267,441.58	2.78
2	600036	招商银行	359,097,163.53	2.73
3	002415	海康威视	338,670,071.74	2.57
4	002202	金风科技	253,375,844.75	1.93
5	002230	科大讯飞	224,824,699.79	1.71
6	600999	招商证券	218,271,888.81	1.66
7	002916	深南电路	94,075,233.54	0.71
8	003816	中国广核	80,734,299.44	0.61
9	600900	长江电力	71,905,811.82	0.55
10	000400	许继电气	71,536,584.87	0.54
11	002063	远光软件	71,466,552.23	0.54
12	600390	五矿资本	70,890,033.32	0.54
13	600150	中国船舶	67,674,829.13	0.51
14	002025	航天电器	65,056,142.79	0.49
15	601668	中国建筑	64,695,815.20	0.49
16	002405	四维图新	63,512,433.93	0.48
17	002179	中航光电	62,874,675.27	0.48
18	000625	长安汽车	62,660,905.87	0.48
19	600760	中航沈飞	60,932,759.18	0.46
20	002106	莱宝高科	60,702,858.78	0.46

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	000768	中航飞机	189,139,920.27	1.44
2	001979	招商蛇口	150,184,045.27	1.14
3	300212	易华录	145,063,028.68	1.10
4	601888	中国中免	130,047,002.99	0.99
5	600050	中国联通	125,791,191.00	0.96
6	601088	中国神华	121,384,102.34	0.92
7	600019	宝钢股份	111,167,886.39	0.84
8	601857	中国石油	109,872,710.00	0.83
9	601989	中国重工	102,234,496.90	0.78
10	600038	中直股份	88,867,744.71	0.68
11	002415	海康威视	87,097,511.69	0.66
12	002368	太极股份	80,117,215.47	0.61
13	600028	中国石化	78,388,973.00	0.60
14	600845	宝信软件	73,107,074.75	0.56
15	600536	中国软件	72,567,564.91	0.55
16	600886	国投电力	71,241,392.04	0.54
17	600497	驰宏锌锗	63,839,109.30	0.49
18	600029	南方航空	62,402,860.15	0.47
19	600236	桂冠电力	62,145,512.32	0.47
20	600161	天坛生物	60,757,721.28	0.46

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	4,104,034,102.86
卖出股票的收入（成交）总额	3,843,227,427.79

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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	46	56,828,400.00	2,551,920.00	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	29	33,636,520.00	1,051,840.00	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。
IH2007	上证 50 股指期货 IH2007 合约	27	23,535,360.00	728,040.00	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	15	18,304,200.00	392,340.00	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	-37,800.00	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。
IH2009	上证 50 股指期货 IH2009 合约	6	5,170,680.00	91,800.00	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					4,778,140.00
股指期货投资本期收益					351,582.39
股指期货投资本期公允价值变动					1,958,840.00

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	15,702,589.51
2	应收证券清算款	690,147.77
3	应收股利	220,503.87
4	应收利息	171,519.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,784,760.20

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)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏中证央企 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
1,726	7,867,642.51	13,254,506,081.00	97.61%	64,429,638.00	0.47%	260,615,250.00	1.92%

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	中国石油天然气集团有限公司	3,963,759,625.00	29.19%
2	北京诚通金控投资有限公司	2,482,117,190.00	18.28%
3	中国石油化工集团有限公司	1,938,000,000.00	14.27%
4	中国中车集团有限公司	1,295,896,777.00	9.54%
5	中国电力建设集团有限公司	1,131,363,515.00	8.33%
6	中国冶金科工集团有限公司	1,019,601,776.00	7.51%
7	中国国有企业结构调整基金股份有限公司	600,220,000.00	4.42%
8	中国海洋石油集团有限公司	326,150,000.00	2.40%
9	中车金证投资有限公司	176,712,040.00	1.30%
10	中兵投资管理有限责任公司	160,086,796.00	1.18%
11	中国农业银行股份有限公司—华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金	260,615,250.00	1.92%

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 10 月 19 日）基金份额总额	15,887,550,969.00
本报告期期初基金份额总额	13,096,550,969.00
本报告期基金总申购份额	2,071,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,588,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,579,550,969.00

§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	
西部证券	1	4,183,437,351.09	52.75%	1,804,281.47	52.75%	-
广发证券	2	3,461,184,433.24	43.64%	1,492,815.56	43.64%	-
方正证券	2	231,181,987.03	2.91%	99,709.44	2.91%	-
中信证券	9	55,346,793.36	0.70%	23,871.29	0.70%	-

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，本基金还选择了北京高华证券、长江证券、东方证券、国泰君安证券、华泰证券、招商证券、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。

④在上述租用的券商交易单元中，中信证券的部分交易单元、招商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
西部证券	196,190.40	3.80%	-	-
广发证券	127,475.50	2.47%	30,000,000.00	100.00%
方正证券	4,845,621.81	93.74%	-	-
中信证券	-	-	-	-

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	2020-03-07
4	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
5	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
6	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
7	华夏基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-20

§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超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020-01-01 至 2020-06-30	3,963,759,625.00	-	-	3,963,759,625.00	29.19%
产品特有风险							
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。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。

§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注册的文件；
- 2、《华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证央企结构调整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