华夏养老目标日期 2045 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：二〇二〇年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）
基金主代码	006620
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 9 日
报告期末基金份额总额	588,393,821.15 份
投资目标	在控制风险的前提下，通过资产配置、基金优选，力求基金资产稳定增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等。在资产配置策略上，本基金属于养老目标日期基金。本基金的资产配置策略，随着投资人生命周期的延续和投资目标日期的临近，基金的投资风格相应的从“进取”，转变为“稳健”，再转变为“保守”，权益类资产比例逐步下降，而非权益类资产比例逐步上升。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：X×沪深 300 指数收益率＋(1-X）×上证国债指数收益率。目标日期 2045 年 12 月 31 日之前（含当日），X 取值范围如下：2019 年-2020 年，X=50%；2021 年-2025 年，X=50%；2026 年-2030 年，X=50%；2031 年-2035 年，X=50%；2036 年-2040 年，X=45%；2041 年-2045 年，X=26%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金中基金（FOF），是目标日期型基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金，属于中等风险的品种。本基金的资产配置策略，随着投资人生命周期的延续和目标日期的临近，基金的投资风格相应的从“进取”，转变为“稳健”，再转变为“保守”，权益类资产比例逐步下降。
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	
下属分级基金的基金简称	华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）A	华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	006620	006621
报告期末下属分级基金的份额总额	545,463,626.86 份	42,930,194.29 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)	
	华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）A	华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）C
1.本期已实现收益	108,696,221.88	8,308,608.34
2.本期利润	53,557,807.54	3,931,215.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.1027	0.0966
4.期末基金资产净值	798,726,892.45	62,493,569.04
5.期末基金份额净值	1.4643	1.4557

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本基金 T 日的基金份额净值在 T+3 日内公告。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏养老2045三年持有混合（FOF）A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.19%	1.34%	5.36%	0.80%	2.83%	0.54%

过去六个月	32.25%	1.18%	12.39%	0.66%	19.86%	0.52%
过去一年	41.34%	1.22%	12.67%	0.69%	28.67%	0.53%
自基金合同生效起至今	46.43%	1.03%	10.62%	0.67%	35.81%	0.36%

华夏养老2045三年持有混合（FOF）C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.09%	1.34%	5.36%	0.80%	2.73%	0.54%
过去六个月	31.99%	1.17%	12.39%	0.66%	19.60%	0.51%
过去一年	40.77%	1.22%	12.67%	0.69%	28.10%	0.53%
自基金合同生效起至今	45.57%	1.03%	10.62%	0.67%	34.95%	0.36%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

华夏养老目标日期 2045 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 4 月 9 日至 2020 年 9 月 30 日)

华夏养老2045三年持有混合（FOF）A：

华夏养老2045三年持有混合（FOF）C：

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

§4 管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许利明	本基金的基金经理、资产配置部总监	2019-04-09	-	22 年	经济学硕士。曾任北京国际信托投资公司投资银行总部项目经理，湘财证券有限责任公司资产管理总部总经理助理等，北京鹿苑天闻投资顾问有限责任公司首席投资顾问，天弘基金管理有限公司投资部副总经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理（2007 年 7 月 27 日至 2009 年 3 月 30 日期间）等，中国国际金融有限公司投资经理等。2011 年 6 月加入华夏基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理，华夏成长证券投资基金基金经理（2015 年 9 月 1 日至 2017 年 3 月 28 日期间）、华夏军工安全灵活配置混合型证券投资基金

					基金经理（2016 年 3 月 22 日至 2017 年 3 月 28 日期间）、华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理（2016 年 3 月 25 日至 2018 年 1 月 17 日期间）等。
李铧汶	本基金的基金经理、资产配置部总监	2019-04-09	2020-09-23	13 年	管理学硕士。曾任易方达基金研究员等。2010 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员、基金经理助理，华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理（2015 年 2 月 9 日至 2016 年 3 月 29 日期间）、华夏成长证券投资基金基金经理（2014 年 3 月 17 日至 2017 年 1 月 13 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公平交易专项说明

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，本公司严格执行了《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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

3 季度初，A 股市场在新冠疫情进一步平稳且全国范围内复产复工正常推进的背景下出现了一波较快上涨，但在其后的大部分时间里，市场处于震荡格局中，没有明确的趋势性行情，也没有明确的板块方向。本基金在操作中依然保持了较高的权益仓位，结构方面调降了科技成长类资产的比例，提升了平稳价值类资产的比例。全季下来，组合净值跟随市场上涨，相对比较基准取得了一定超额收益，但较上半年相比，超额收益的幅度不高。

由于本基金是 FOF 基金，与传统的股票或债券基金存在很多不同，因此关于 FOF 基金的投资理念和方法，谈一点个人看法。FOF 基金是一种基于资产配置思路的投资基金，在我国是一个较新的领域。我们可以借鉴和学习的经验主要来自美欧等发达国家资本市场的实践。但我国当前资本市场的环境与发达资本市场有明显的差异，即风险与收益的对比关系的不同。

通常用来度量一个资本市场风险水平的方法是度量它的波动性。我国资本市场的波动性显著高于发达国家资本市场，但在过去相当长的时间里，我国资本市场的回报未能达到高波动所要求的合理风险补偿。在这种背景下，我们简单要求投资者遵循“价值投资”理念，“长期投资”原则是不合理的。因此，在我国做资产配置的基本原则，除了自上而下，基于波动性的风险度量外，自下而上，基于投资方向的风险调整同样重要。只有这样才可能有效改善整体 FOF 组合的风险收益比。

在自下而上做风险调整时，我们需要考虑三个问题：一是，决策的时间维度与市场波动的关系。决策周期过短，可能陷入择时的泥潭，而决策周期过长，则可能失去风险调整的意义。具体决策周期的确定，需要依据市场环境的变化做动态调整，不应一成不变。二是，我们必须有效甄别一段时间内影响市场的主导因素。宏观经济不是影响市场波动的唯一因素，很多时候也不是主导因素。但我们也不可能对可能影响到市场的每一个因素都做面面俱到的研究，因为从决策效率角度，这样做不合理。因此，根据具体的市场环境分析影响市场的主导因素非常重要。而在这种时候，回溯历史数据往往参考意义不大。三是，在具体的投资方向上，由于受到的制约因素不同，各方向的波动规律也不一样。在不同因素制约市场的情况下，不同类别投资方向之间，波动的相关性也不一样。

在选择具体基金品种时，基金经理具有较为成熟稳定且自洽的投资框架是基本要求。在这个基础上，基金经理风格与当期资本市场的契合程度以及基金经理之间风格风险的对冲是要着重考虑的两大因素。每个基金经理的投资方法都不可能适应所有的市场环境，总有一些时候可能因为投资风格与市场环境不契合而出现短期业绩落后。每当出现这种情况时，具体基金经理除了反思自己投资框架不完善的地方并努力改变之外，我们 FOF 投资经理也应该依据对基金经理投资框架的理解，分析其投资框架失灵可能的时间长短，以及可能落后的幅度。如果基金经理投资框架失

灵的潜在时间较长或落后的可能幅度较大，我们有必要采取止损措施，以力争 FOF 组合整体风险收益比更优。以基金经理的持股周期为例，虽然没有证据表明基金经理的业绩与其持股周期有明显的相关性。但持股周期可以给我们提供两项信息，一是，持股周期越长的基金经理，其投资风格越容易界定，且其投资风格与当下市场的契合程度越容易甄别；二是，持股周期越长的基金经理，其投资风格发生漂移的可能性就越小，且越容易跟踪。因此我们选择基金品种时，大多时候倾向于持股相对稳定的基金经理，但不意味着这类基金经理在短期内更可能有更优异的业绩表现。同样的，在主动型基金和被动型基金的选择上也一样。对于那些行业内部各企业差异较大，基金经理有可能挖掘出更优秀的企业的行业，我们倾向于选择主动型基金。而那些行业内部企业差异较小，或者企业间的差异难于被基金经理捕捉到的行业，我们倾向于选择被动型基金。

从长期来看，我们对中国资本市场的前景抱乐观态度，对中国基金行业为投资者做出持续贡献的能力充满信心。我们相信，市场中会有越来越多的基金经理，通过他们的努力，为持有人选出在商业竞争中表现优秀的企业，通过分享这类企业的经营成果为投资者获取收益。同时，我们也相信，通过深入研究基金经理的投资框架与理念，我们有机会找到有这些能力的基金经理，与他们一起为我们 FOF 的持有人获取收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 9 月 30 日，华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）A 基金份额净值为 1.4643 元，本报告期份额净值增长率为 8.19%；华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）C 基金份额净值为 1.4557 元，本报告期份额净值增长率为 8.09%，同期业绩比较基准增长率为 5.36%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	144,292,680.23	16.20
	其中：股票	144,292,680.23	16.20
2	基金投资	696,165,338.98	78.17
3	固定收益投资	39,747,000.00	4.46

	其中：债券	39,747,000.00	4.46
	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	6,132,066.11	0.69
8	其他各项资产	4,290,965.23	0.48
9	合计	890,628,050.55	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	-	-
C	制造业	82,571,891.19	9.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	4,732,322.79	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	6,547,392.00	0.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,369,725.68	1.67
J	金融业	16,146,596.45	1.87
K	房地产业	4,315,080.00	0.50
L	租赁和商务服务业	6,684,768.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	3,806,250.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	5,105,625.00	0.59
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	144,292,680.23	16.75

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	38,600	8,075,120.00	0.94
2	300059	东方财富	326,180	7,825,058.20	0.91
3	000858	五 粮 液	33,000	7,293,000.00	0.85
4	603069	海汽集团	252,600	6,547,392.00	0.76
5	600138	中青旅	487,200	5,359,200.00	0.62
6	600436	片仔癀	21,700	5,280,044.00	0.61
7	300010	豆神教育	277,400	5,112,482.00	0.59
8	002159	三特索道	437,500	5,105,625.00	0.59
9	600993	马应龙	225,300	4,715,529.00	0.55
10	002736	国信证券	335,605	4,513,887.25	0.52

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,747,000.00	4.62
	其中：政策性金融债	39,747,000.00	4.62
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,747,000.00	4.62

5.5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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	200211	20 国开 11	300,000	29,721,000.00	3.45
2	160416	16 农发 16	100,000	10,026,000.00	1.16
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

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

5.11.2 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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	65,591.04
2	应收证券清算款	1,634,252.63
3	应收股利	-
4	应收利息	292,466.42
5	应收申购款	2,298,655.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,290,965.23

5.11.4报告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。

5.11.5报告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。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	450001	国富中国收益混合	契约型开放式	44,675,000.00	65,462,277.50	7.60	否
2	270002	广发稳健增长混合 A	契约型开放式	32,949,038.39	57,515,841.41	6.68	否
3	004965	泓德致远混合 A	契约型开放式	25,051,906.84	46,601,557.10	5.41	否
4	002251	华夏军工	契约型开	30,516,253.11	42,631,205.59	4.95	是

		安全混合	放式				
5	004686	华夏研究精选股票	契约型开放式	26,665,389.90	40,560,724.58	4.71	是
6	000011	华夏大盘精选混合	契约型开放式	2,146,422.01	39,680,903.70	4.61	是
7	001796	汇添富安鑫智选混合 A	契约型开放式	30,737,194.47	38,944,025.39	4.52	否
8	288001	华夏经典配置混合	契约型开放式	25,626,842.57	38,799,039.65	4.51	是
9	000584	新华鑫益灵活配置混合	契约型开放式	8,467,054.49	33,114,650.11	3.85	否
10	519918	华夏兴和混合	契约型开放式	14,000,000.00	32,788,000.00	3.81	是

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	93,564.04	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	3,166,649.56	1,415,070.97
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	65,597.48	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,316,925.61	702,684.12
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	398,346.64	118,567.74
当期交易基金产生的交易费（元）	6,626.33	714.43

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应

当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏养老2045三年持有混合（FOF）A	华夏养老2045三年持有混合（FOF）C
本报告期期初基金份额总额	490,495,319.01	36,549,114.79
报告期基金总申购份额	54,968,307.85	6,381,079.50
减：报告期基金总赎回份额	-	-
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	545,463,626.86	42,930,194.29

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

8.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2020 年 7 月 2 日发布华夏基金管理有限公司住所变更公告。

2020 年 8 月 22 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2020 年 8 月 29 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2020 年 9 月 12 日发布华夏基金管理有限公司关于上海分公司营业场所变更的公告。

2020 年 9 月 23 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2020 年 9 月 24 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2020 年 9 月 25 日发布华夏基金管理有限公司关于调整华夏养老目标日期 2045 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理的公告。

2、其他相关信息

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、华夏上证科创板 50 成份 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏中证浙江国资创新发展 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 9 月 30 日数据），华夏双债债券(A 类)、华夏聚利债券（A）及华夏债券(A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（A 类）”中分别排序 1/187、2/187 和 7/187；华夏鼎利债券 (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）”中排序 2/241；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 8/341；华夏可转债增强债券(A 类) 在“债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金（A 类）”中排序 5/36；华夏创新前沿股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 6/203 ；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(C 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（非 A 类）”中排序 7/42；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 3/35 和 4/35；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 9/21；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 1/78；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 1/35 和 2/35；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 6/53；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 2/16 和 3/16；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 2/28。

在客户服务方面，3 季度，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）优化部分直销电子交易支付渠道，提高了相关支付限额，为投资者交易提供了便利；（2）华夏基金管家客户端优化了基金筛选功能，方便客户多维度对基金进行筛选与定位；（3）开展“以家人之名”、“误入弹幕，找出它”、“看人家一岁的时候”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§10 备查文件目录

10.1备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件；

2、《华夏养老目标日期 2045 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《华夏养老目标日期 2045 三年持有期混合型基金中基金（FOF）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。

10.2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。

10.3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

二〇二〇年十月二十七日