

华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混

合型发起式

证券投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 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：二〇二一年七月二十日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月16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2021年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏安泰对冲策略3个月定开混合
基金主代码	008856
交易代码	008856
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年6月5日
报告期末基金份额总额	586,026,300.17份
投资目标	在有效控制系统性风险的基础上，运用量化模型建立投资组合，通过衍生工具对冲市场风险，力争实现长期稳健的绝对收益。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、绝对收益策略、债券投资策略、股指期货和股票期权投资策略、国债期货投资策略、融资融券投资策略、存托凭证投资策略等。本基金所指的绝对收益策略包括 ALPHA 对冲策略、套利策略、衍生品交易策略、融资融券策略等。本基金以基金管理人自主开发的量化多因子模型为基础，灵活运用多种投资策略建立投资组合，在有效控制风险的前提下，通过金融衍生品工具对冲市场风险，力争实现长期稳健的绝对收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。
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

§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
	(2021年4月1日-2021年6月30日)
1.本期已实现收益	22,225,809.27
2.本期利润	17,930,019.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0436
4.期末基金资产净值	634,912,834.25
5.期末基金份额净值	1.0834

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。

3.2 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

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	3.65%	0.23%	0.87%	0.00%	2.78%	0.23%
过去六个月	8.78%	0.31%	1.74%	0.00%	7.04%	0.31%
过去一年	8.05%	0.32%	3.50%	0.00%	4.55%	0.32%
自基金合同生效起至今	8.34%	0.31%	3.74%	0.00%	4.60%	0.31%

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

华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年6月5日至2021年6月30日)



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

§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		
孙蒙	本基金的基金经理	2020-06-05	-	7年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017年7月加入华夏基金管理有限公司。曾任数量投资部研究员、基金经理助理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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

2季度，全球经济逐步复苏，疫苗接种速度加快，海外新冠肺炎疫情先大幅恶化后持续改善，全球经济恢复的确定性进一步增强，通胀预期有所升温。美国制造业和服务业均强劲恢复，美联储6月议息会议决定维持利率政策按兵不动，但大幅提高通胀和经济增长预期，过半数委员预测2023年底前可能会加息两次；欧洲央行维持宽松政策，3季度或将继续加快购债速度；日本疫苗接种率较低，经济恢复缓慢，维持宽松政策，日元略有贬值。国内方面，主要生产需求指标同比增速受上年同期基数升高的影响有所放缓，但环比增速保持稳定；创新驱动战略实施成效继续显现，高技术产业发展向好，神舟十二号载人飞船成功发射，新业态持续保持迅猛发展态势；三胎政策实施有利于促进人口结构长期均衡发展；猪肉价格进入下行周期，CPI涨幅温和，货币政策坚持了稳字当头。

市场方面，A股市场震荡上涨，行情结构分化较大，行业内部个股表现差异也较大。新能源、医疗等板块表现最好，不少个股创出历史新高；家电、保险和地产不断下跌。策略方面，本基金所采用的量化模型在今年以来的宽幅震荡行情下体现了较强的适应能力，模型整体表现稳健。

基金投资运作方面，股票端以多因子量化投资策略为主，对冲端通过股指期货对冲市场风险，力争获取绝对收益表现。我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年6月30日,本基金份额净值为1.0834元,本报告期份额净值增长率为3.65%,同期业绩比较基准增长率为0.87%。

§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	517,579,437.61	81.25
	其中: 股票	517,579,437.61	81.25
2	固定收益投资	128,100.00	0.02
	其中: 债券	128,100.00	0.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	30,000,000.00	4.71
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	32,946,495.06	5.17
7	其他各项资产	56,339,592.91	8.84
8	合计	636,993,625.58	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	6,475,848.08	1.02
B	采矿业	16,664,564.20	2.62
C	制造业	288,505,034.10	45.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,835,780.60	2.18

E	建筑业	10,273,504.44	1.62
F	批发和零售业	1,408,292.82	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	10,757,456.95	1.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,226,684.93	4.92
J	金融业	106,086,961.36	16.71
K	房地产业	8,159,047.00	1.29
L	租赁和商务服务业	11,022,783.50	1.74
M	科学研究和技术服务业	8,972,544.30	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	471,359.33	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	878,735.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	2,703,816.00	0.43
S	综合	137,025.00	0.02
	合计	517,579,437.61	81.52

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600519	贵州茅台	12,490	25,688,183.00	4.05
2	600809	山西汾酒	29,709	13,309,632.00	2.10
3	300122	智飞生物	61,400	11,465,222.00	1.81
4	600036	招商银行	199,535	10,812,801.65	1.70
5	601211	国泰君安	524,162	8,984,136.68	1.42
6	300782	卓胜微	16,120	8,664,500.00	1.36
7	603489	八方股份	36,650	8,663,327.00	1.36
8	600563	法拉电子	52,600	8,329,736.00	1.31
9	601398	工商银行	1,562,700	8,079,159.00	1.27
10	601888	中国中免	25,235	7,573,023.50	1.19

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	-	-
	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）	128,100.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	128,100.00	0.02

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	123117	健帆转债	1,281	128,100.00	0.02
2	-	-	-	-	-
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

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2107	中证500股指期货 IC2107 合约	-28	-37,896,320.00	-1,188,600.00	本基金投资股指期货以套期保值为主要目的，从而更有

					效地进行风险管理，以实现投资目标。
IF2109	沪深300股指期货 IF2109 合约	-94	-145,692,480.00	-9,275,071.14	本基金投资股指期货以套期保值为主要目的，从而更有效地进行风险管理，以实现投资目标。
IF2107	沪深300股指期货 IF2107 合约	-175	-272,538,000.00	-1,386,526.36	本基金投资股指期货以套期保值为主要目的，从而更有效地进行风险管理，以实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					-11,850,197.50
股指期货投资本期收益(元)					-6,269,775.59
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-12,007,804.41

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

(1) 股指期货对冲策略

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。

(2) 股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

①期现套利：期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

②跨期套利：跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 517,579,437.61 元，占基金资产净值的比例为 81.52%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-456,126,800.00 元，占基金资产净值的比例为-71.84%，空头合约市值占股票资产的比例为-88.13%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 24,879,185.55 元，公允价值变动损益为-4,267,397.52 元。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	55,725,374.72
2	应收证券清算款	602,389.33
3	应收股利	-
4	应收利息	11,828.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,339,592.91

5.12.4 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。

5.12.5 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。

5.12.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	346,740,160.41
报告期期间基金总申购份额	337,058,949.20
减：报告期期间基金总赎回份额	97,772,809.44
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	586,026,300.17

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,900.09
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,900.09
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.71

7.2 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。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	1.71%	10,000,000.00	1.71%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-

基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,900.09	1.71%	10,000,000.00	1.71%	不少于三年

§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

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	2021-04-01至 2021-06-07	98,463,644.40	-	-	98,463,644.40	16.80%

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。

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

2021年4月2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。

2021年4月7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。

2021年4月9日发布华夏基金管理有限公司公告。

2021年4月9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。

2021年4月21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。

2021年5月8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。

2021年5月12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。

2021年5月13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。

2021年5月18日发布华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告。

2021年5月19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。

2021年5月25日发布华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告。

2021年5月28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。

2021年6月4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。

2021年6月5日发布华夏基金管理有限公司关于华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金延长开放期的公告。

2021年6月9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。

2021年6月17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。

2021年6月18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。

2021年6月19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。

2021年6月30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。

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，目前旗下管理上证50ETF(510050)、300ETF基金(510330)、MSCIA股ETF(512990)、500ETF基金(512500)、中小100(159902)、双创基金(159783)、创业板HX(159957)、科创50ETF(588000)、中证1000(159845)、央企改革ETF(512950)、四川国改(159962)、浙江国资ETF(515760)、战略新兴ETF(512770)、5GETF(515050)、人工智能AIETF(515070)、芯片ETF(159995)、新能源车ETF(515030)、智能车(159888)、高端装备ETF(516320)、大湾区(159983)、沪港深ETF(517170)、消费ETF基金(510630)、金融地产ETF(510650)、医药卫生ETF(510660)、食品饮料ETF(515170)、券商ETF基金(515010)、银行ETF华夏(515020)、房地产ETF基金(515060)、大数据50ETF(516000)、生物科技ETF(516500)、新能源80ETF(516850)、游戏ETF(159869)、有色50ETF(516650)、

创蓝筹(159966)、创成长(159967)、恒生ETF(513660)、恒生ETF(159920)、恒生科技指数ETF(513180)、恒生互联网ETF(513330)、H股50(159850)、日经ETF(513520)、纳斯达克ETF(513300)、中期信用ETF(511280)、豆粕ETF(159985)、黄金ETF9999(518850),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《中国基金业绩评价报告》,截至2021年6月30日,华夏基金旗下多只产品近1年同类排名领先(基金排名不作为产品未来表现的保证),其中:

主动权益产品:在QDII混合基金(A类)中华夏新时代混合(QDII)排序第1/36、华夏移动互联混合(QDII)排序第4/36;在其他行业股票型基金(A类)中华夏能源革新股票排序第2/36;在消费行业偏股型基金(股票上下限60%-95%)(A类)中华夏新兴消费混合(A类)排序第2/21;在标准股票型基金(A类)中华夏潜龙精选股票排序第37/226;在绝对收益目标基金(A类)中华夏回报混合(A类)排序第25/139、华夏回报二号混合排序第27/139;在灵活配置型基金(股票上下限0-95%+基准股票比例30%60%)(A类)中华夏军工安全混合排序第39/491;在灵活配置型基金(股票上下限0-95%+基准股票比例30%-60%)(A类)中华夏高端制造混合排序第15/491、华夏稳盛混合排序第54/491;在偏股型基金(股票上下限60%-95%)(A类)中华夏行业景气混合排序第9/566、华夏行业龙头混合排序第36/566;在偏股型基金(股票上限80%)(A类)中华夏经典混合排序第11/128;在偏股型基金(股票上限95%)(A类)中华夏兴和混合排序第11/168、华夏兴华混合(A类)排序第32/168、华夏大盘精选混合(A类)排序第40/168;在偏债型基金(A类)中华夏睿磐泰茂混合(A类)排序第44/149。FOF类产品中,在养老目标风险FOF(权益资产0-30%)(A类)中华夏稳健养老一年持有混合(FOF)排序第4/20;在QDII混合基金(A类)中华夏全球聚享(QDII)(A类)排序第10/36;

固收与固收+产品:在普通债券型基金(可投转债)(A类)中华夏聚利债券排序第1/196、华夏双债债券(A类)排序第3/196、华夏债券(A/B类)排序第12/196;在可转换债券型基金(A类)中华夏可转债增强债券(A类)排序第3/34;在定期开放式纯债债券型基金(摊余成本法)(A类)中华夏恒泰64个月定开债券排序第12/73;在短期纯债债券型基金(A类)中华夏短债债券(A类)排序第12/53;在偏债型基金(A类)中华夏永康添福混合排序第18/149;在普通债券型基金(二级)(A类)中华夏安康债券(A类)排序第40/248、华夏鼎利债券(A类)排序第41/248。在QDII债券型基金(非A类)中华夏收益债券(QDII)(A类)(美元)排

序第2/35、华夏大中华信用债券（QDII）（A类）（美元）排序第4/35；

指数与量化产品：在策略指数股票ETF基金中华夏创成长ETF排序第1/22、华夏创蓝筹ETF排序第6/22；在规模指数股票ETF基金中华夏创业板ETF排序第1/90、华夏MSCI中国A股国际通ETF排序第26/90；在行业指数股票ETF基金中华夏消费ETF排序第4/39、华夏医药ETF排序第5/39；在增强规模指数股票型基金（A类）中华夏中证500指数增强（A类）排序第6/93；在主题指数股票ETF基金中华夏中证新能源汽车ETF排序第3/88、华夏中证四川国改ETF排序第8/88、华夏战略新兴成指ETF排序第11/88。

在客户服务方面，2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）华夏基金直销上线邮储银行卡直连支付方式，进一步拓展了支付渠道；（2）管家客户端上线理财小管家和微信登录功能，方便客户及时了解市场观点、投资者教育等信息，也为客户提供了多样的登录方式；（3）与众惠基金等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“发个暗号，看多少人在嗑这对CP？”、“我是真的追不上”、“风往哪吹”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、《华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式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。

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

二〇二一年七月二十日