

**华夏上证科创板 50 成份交易型开放式指数**

**证券投资基金**

**2021 年第 3 季度报告**

**2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十六日

## §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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 华夏上证科创板 50 成份 ETF   |
| 场内简称       | 科创 50（扩位证券简称：科创 50ETF）  |
| 基金主代码      | 588000  |
| 交易代码       | 588000  |
| 基金运作方式     | 交易型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2020 年 9 月 28 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 15,673,168,177.00 份   |
| 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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。  |
| 投资策略       | 主要投资策略包括组合复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略、衍生品投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。  |
| 业绩比较基准     | 上证科创板 50 成份指数收益率。   |
| 风险收益特征     | 本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金资产投资于科创板，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。 |
| 基金管理人      | 华夏基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司  |

## §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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) |
|----------------|----------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 717,842,144.42                   |
| 2.本期利润         | -2,759,089,372.20                |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2137                          |
| 4.期末基金资产净值     | 22,278,851,918.85                |
| 5.期末基金份额净值     | 1.4215                           |

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。

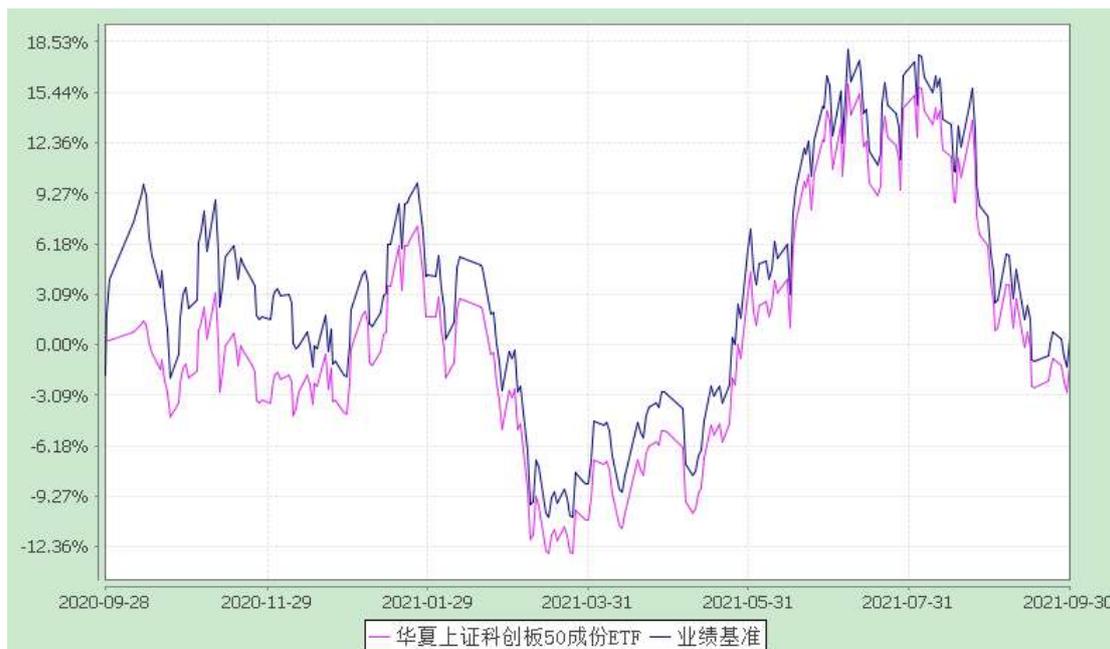
### 3.2 基金净值表现

#### 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      | -13.65% | 1.69%     | -13.82%    | 1.70%         | 0.17%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 10.61%  | 1.65%     | 9.64%      | 1.65%         | 0.97%  | 0.00%  |
| 过去一年       | -1.54%  | 1.57%     | -3.53%     | 1.64%         | 1.99%  | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.28%  | 1.56%     | 0.34%      | 1.66%         | -1.62% | -0.10% |

#### 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

华夏上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金  
 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 9 月 28 日至 2021 年 9 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 |        |  |
| 张弘弢 | 本基金的基金经理、投委会成员 | 2020-09-28  | -    | 21 年   | 硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司。曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>(2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 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 (2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、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 (2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间)、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 3 月 15 日至 2021 年 1 月 5 日期间)、华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 7 月 14 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰荣</p> |
|--|--|--|--|--|

|    |                |            |   |     |  |
|----|----------------|------------|---|-----|--|
|    |                |            |   |     | <p>混合型证券投资基金基金经理(2017年12月27日至2021年5月26日期间)、华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金经理(2019年2月27日至2021年5月26日期间)、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理(2021年1月6日至2021年5月26日期间)、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日至2021年5月27日期间)等。</p>   |
| 荣膺 | 本基金的基金经理、投委会成员 | 2020-09-28 | - | 11年 | <p>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联接基金基金经理(2016年10月20日至2018年9月16日期间)、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2015年11月6日至2020年3月18日期间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理</p> |

|  |  |  |  |  |                                       |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------|
|  |  |  |  |  | (2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)等。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------|

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名  | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值(元)            | 任职时间       |
|-----|----------|---------|--------------------|------------|
| 张弘弢 | 公募基金     | 8       | 119,203,810,346.08 | 2009-07-10 |
|     | 私募资产管理计划 | 1       | 30,623,925.42      | 2021-07-16 |
|     | 其他组合     | -       | -                  | -          |
|     | 合计       | 9       | 119,234,434,271.50 | -          |

#### 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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共有 14 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 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

本基金跟踪的标的指数为上证科创板 50 成份指数，上证科创板 50 成份指数由上海证券交易所科创板中市值大、流动性好的 50 只证券组成，反映最具市场代表性的一批科创企业的整体表现。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

3 季度，国内因德尔塔病毒疫情出现零星散发，海外国家主张全民免疫策略，逐步强行废除封禁，发展中国家疫情防控仍不乐观。经济层面，全球大宗商品价格暴涨成为市场焦点。国内资源品主要分两类，一类是受益于光伏、新能源车需求大增，产能供不应求而价格大涨的，以锂、钴、工业硅、纯碱、PVDF 等为代表；第二类是因限产导致供应不足而价格大涨，以动力煤、焦煤、焦炭、螺纹钢、电解铝、黄磷等为代表。我们观察到 PPI-CPI 差值达到有历史记录以来的最高值，这意味着下游需求不足，利润集中到上游资源，中游制造业利润被挤压。如果叠加停电限产，中游制造业的利润存在忧虑。

财政和货币政策层面，相对温和。7 月政治局会议要求财政实现实物量，7 月央行超预期降准，都说明当前是宽财政+宽货币的政策组合。产业政策方面，有保有压，既有新能源、硬科技等产业的利好政策，又有互联网反垄断、打击教育培训机构等产业规范政策。

市场方面，整体走势先扬后抑，热点集中，波动较大，风格极致。市值风格维度，中小市值风格表现明显强于大市值风格；估值风格维度，成长和价值两条主线均有所表现，在成长风格估值较高、PPI 大幅上行的背景下，市场开始降低风险偏好，低估值风格逐渐走强；行业维度，市场重点关注以下行业：成长性行业，如光伏、新能源车、半导体、军工；低估值行业，如煤炭、钢铁、有色、化工，其中，愈发紧缺的煤电，使得长期被市场忽视的火电、风电、核电、电力运营、电力系统行业获得市场高度关注。

风险层面，全球范围的大宗商品价格上涨，以及随之带来的能源短缺问题是市场高度重视，尤其在拉尼娜效应增强，冬季极寒概率较大，恐加剧能源供给不足问题；美联储缩减购债规模箭在弦上，加之美国国内与日俱增的通胀压力和高悬在上的金融资产，市场对提防海外市场大幅波动的“灰犀牛”事件开始予以反映。

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、赎回和成份股调整等工作。

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信建投股份有限公司、国泰

君安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、广发证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.4215 元，本报告期份额净值增长率为 -13.65%，同期业绩比较基准增长率-13.82%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.17%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

#### 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              | 22,184,743,828.01 | 99.50        |
|    | 其中：股票             | 22,184,743,828.01 | 99.50        |
| 2  | 固定收益投资            | -                 | -            |
|    | 其中：债券             | -                 | -            |
|    | 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          | -                 | -            |
|    | 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      | 99,341,219.90     | 0.45         |
| 7  | 其他各项资产            | 12,334,455.58     | 0.06         |

|   |    |                   |        |
|---|----|-------------------|--------|
| 8 | 合计 | 22,296,419,503.49 | 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 2,031,884,174.00 元,占本基金期末资产净值的 9.12%。

## 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              | 16,913,524,939.72 | 75.92        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,299,875.22      | 0.03         |
| E  | 建筑业              | -                 | -            |
| F  | 批发和零售业           | -                 | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                 | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                 | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,264,880,954.15  | 23.63        |
| J  | 金融业              | -                 | -            |
| K  | 房地产业             | -                 | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                 | -            |
| 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               | 22,184,705,769.09 | 99.58        |

## 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  | 688981 | 中芯国际 | 37,478,264 | 2,068,800,172.80 | 9.29   |
| 2  | 688111 | 金山办公 | 5,942,710  | 1,683,688,597.20 | 7.56   |
| 3  | 688012 | 中微公司 | 7,920,993  | 1,198,023,737.40 | 5.38   |
| 4  | 688036 | 传音控股 | 7,713,671  | 1,087,627,611.00 | 4.88   |
| 5  | 688005 | 容百科技 | 8,637,667  | 933,559,049.36   | 4.19   |
| 6  | 688116 | 天奈科技 | 5,977,870  | 897,158,729.60   | 4.03   |
| 7  | 688008 | 澜起科技 | 14,555,232 | 864,726,333.12   | 3.88   |
| 8  | 688388 | 嘉元科技 | 5,195,317  | 736,080,498.87   | 3.30   |
| 9  | 688099 | 晶晨股份 | 6,617,758  | 689,438,028.44   | 3.09   |
| 10 | 688002 | 睿创微纳 | 7,170,560  | 628,858,112.00   | 2.82   |

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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                            |
|-------------------|--------------------------|-----|---------------|---------------|---------------------------------|
| IC2110            | 中证 500 股指期货<br>IC2110 合约 | 20  | 28,391,200.00 | -1,361,040.00 | 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。 |
| 公允价值变动总额合计(元)     |                          |     |               |               | -1,361,040.00                   |
| 股指期货投资本期收益(元)     |                          |     |               |               | 3,195,155.73                    |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |                          |     |               |               | -1,276,160.00                   |

5.9.2 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。

#### 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   | 4,430,767.86  |
| 2  | 应收证券清算款 | 6,830,070.67  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 1,073,617.05  |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 12,334,455.58 |

##### 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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明      |
|----|--------|------|----------------|--------------|---------------|
| 1  | 688981 | 中芯国际 | 375,586,320.00 | 1.69         | 转融通出借<br>证券受限 |
| 2  | 688012 | 中微公司 | 248,648,400.00 | 1.12         | 转融通出借<br>证券受限 |
| 3  | 688116 | 天奈科技 | 183,727,936.00 | 0.82         | 转融通出借<br>证券受限 |
| 4  | 688388 | 嘉元科技 | 127,188,450.00 | 0.57         | 转融通出借<br>证券受限 |
| 5  | 688005 | 容百科技 | 66,750,208.00  | 0.30         | 转融通出借<br>证券受限 |
| 6  | 688012 | 中微公司 | 41,157,000.00  | 0.18         | 大宗转让流<br>通受限  |
| 7  | 688388 | 嘉元科技 | 17,669,400.00  | 0.08         | 大宗转让流<br>通受限  |
| 8  | 688111 | 金山办公 | 15,242,616.00  | 0.07         | 转融通出借<br>证券受限 |
| 9  | 688036 | 传音控股 | 10,744,200.00  | 0.05         | 转融通出借<br>证券受限 |
| 10 | 688008 | 澜起科技 | 8,560,981.00   | 0.04         | 转融通出借<br>证券受限 |
| 11 | 688099 | 晶晨股份 | 7,032,150.00   | 0.03         | 转融通出借<br>证券受限 |
| 12 | 688002 | 睿创微纳 | 6,200,390.00   | 0.03         | 转融通出借<br>证券受限 |

## 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 开放式基金份额变动

单位：份

|                |                   |
|----------------|-------------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 12,215,168,177.00 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 7,306,000,000.00  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 3,848,000,000.00  |
| 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   | 15,673,168,177.00 |

## §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

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。

### 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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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   |
| 华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 | 1              | 2021-07-02 至 2021-09-28, 2021-09-30 | 2,379,670,934.00 | 1,151,563,954.00 | 375,237,708.00 | 3,155,997,180.00 | 20.14% |

#### 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。

### 8.2 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 7 月 3 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 7 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。

2021 年 7 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。

2021 年 7 月 26 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 8 月 5 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 8 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 8 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。

## 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，首批公募 MOM 基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，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，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 9 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）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 2/35、华夏新时代混合（QDII）排序第 8/35；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票（A 类）排序第 3/37；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 3/614、华夏盛世混合排序第 20/614；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 6/130；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 8/24；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 10/174、华夏兴华混合（A 类）排序第 16/174；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 33/494、华夏国企改革混合排序第 66/494、华夏新起点混合（A 类）排序第 78/494；在标准股票型基金（A 类）中华夏潜龙精选股票排序第 38/240、华夏优势精选股票排序第 43/240、华夏创新前沿股票排序第 76/240。

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 1/23；在规模指数股票 ETF 基金中华夏创业板 ETF 排序第 1/101；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 3/90、华夏中证四川国改 ETF 排序第 8/90、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 16/90、华夏中证央企 ETF 排序第 24/90、华夏战略新兴成指 ETF 排序第 26/90；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 4/101；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排序第 8/43、华夏医药 ETF 排序第 9/43、华夏消费 ETF 排序第 11/43。

固收&“固收+”产品：在 QDII 债券型基金（A 类）中华夏大中华信用债券（QDII）（A 类）排序第 1/25、华夏收益债券（QDII）（A 类）排序第 2/25；在普通债券型基金（可投转债）（A 类）中华夏聚利债券排序第 3/206、华夏双债债券(A 类)排序第 7/206、华夏债券(A/B 类)排序第 23/206；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 4/191、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 23/191、华夏睿磐泰兴混合排序第 24/191、华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 29/191、华夏睿磐泰荣混合(A 类)排序第 35/191；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A 类)排序第 6/54；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 12/78；在绝对收益目标基金（A 类）中华夏永福混合(A 类)排序第 39/138；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 8/34；在中短期纯债债券型基金（A 类）中华夏中短债债券(A 类)排序第 14/76；在普通债券型基金（二级）（A 类）中华夏鼎泓债券(A 类)排序第 31/254、华夏鼎利债券(A 类)排序第 72/254；在长期纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎航债券(A 类)排序第 27/586、华夏鼎通债券(A 类)排序第 33/586。

养老&FOF 产品：在养老目标日期 FOF（2040）（A 类）中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 1/10；在混合型 FOF（权益资产 0-30%）（A 类）中华夏聚丰混合（FOF）（A 类）排序第 1/10、华夏聚惠 FOF(A 类)排序第 2/10；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 5/27。

3 季度，在《中国证券报》第十八届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内唯一连续 6 年获此殊荣的基金公司。在《证券时报》第十六届中国基金业明星基金奖评选中，公司层面，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“三年持续回报股票型明星基金奖”，华夏永福混合荣获“三年持续回报绝对收益策略明星基金奖”，华夏移动互联混合（QDII）“三年持续回报主动权益类 QDII 明星基金奖”。在已经举办的十六届基金业明星基金奖评选中，华夏基金累计斩获奖杯

数已达 49 座。第三届济安群星汇颁奖盛典获奖名单已发布，华夏基金共获得了 10 个奖项，分别是“基金公司单项奖-指数型”、“基金公司单项奖-一级债”、华夏上证 50ETF 获得“基金产品单项奖-指数型”、华夏聚利债券获得“基金产品单项奖-一级债”、华夏能源革新股票、华夏上证 50ETF、华夏双债债券、华夏新时代混合（QDII）、华夏移动互联混合（QDII）获得“五星基金明星奖”。在《上海证券报》主办的第十八届“金基金”奖评选活动中，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”，华夏创新前沿股票荣获“金基金 股票型基金三年期奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”，华夏能源革新股票荣获“金基金 社会责任投资（ESG）基金奖”。

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）华夏基金直销上线招商银行卡大额支付业务，进一步满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端增加累计收益率、持有收益率、定投标志等信息，并对登录方式进行便捷优化；（3）与泰信财富等销售机构开展代销合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“准备好了吗？来跟我们一起碳中和！”、“定位在太空的朋友圈”、“铁柱姑娘想对你说的话”等活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏上证科创板 50 成份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。

### 9.2 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。

### 9.3 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

二〇二一年十月二十六日