

华夏聚鑫优选六个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：二〇二二年一月二十一日

§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 2022 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）	
基金主代码	012776	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 15 日	
报告期末基金份额总额	3,556,667,363.14 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	<p>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，可转换债券、可交换债券投资策略等。在资产配置策略上，本基金的资产配置通过结合风险预算模型与宏观基本面分析确定，同时随着市场环境的变化引入战术资产配置对组合进行适时调整。</p> <p>在基金投资策略上，本基金在确定资产配置方案后通过定性与定量相结合的方法对基金数据进行分析，得出适合投资目标的备选基金，并通过最优算法得出基金配置比例，构建基金组合。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合（全价）指数收益率×80%	
风险收益特征	本基金属于混合型基金中基金（FOF），其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）A	华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	012776	012777
报告期末下属分级基金的份额总额	2,416,140,996.05 份	1,140,526,367.09 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	
	(2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）A	华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）C
1.本期已实现收益	24,501,466.39	10,435,161.00
2.本期利润	26,422,665.99	11,392,442.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0110	0.0100
4.期末基金资产净值	2,442,113,259.16	1,151,435,691.90
5.期末基金份额净值	1.0107	1.0096

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

华夏聚鑫优选六个月持有混合（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	1.10%	0.09%	0.82%	0.16%	0.28%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	1.07%	0.08%	0.57%	0.16%	0.50%	-0.08%

华夏聚鑫优选六个月持有混合（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	1.00%	0.09%	0.82%	0.16%	0.18%	-0.07%
自基金合同	0.96%	0.09%	0.57%	0.16%	0.39%	-0.07%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

华夏聚鑫优选六个月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

(2021 年 9 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日)

华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）A:



华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）C:



注：①本基金合同于 2021 年 9 月 15 日生效。

②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		
廉赵峰	本基金的基金经理	2021-09-15	-	11 年	硕士。曾任招商银行北京分行财富管理部产品经理、中国国际金融有限公司财富管理部产品经理、中信银行总行零售银行部产品经理、招商银行总行财富管理部产品经理。2018 年 12 月加入华夏基金管理有限公司。曾任资产配置部研究员、基金经理助理。

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。

4.2 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 18 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

感谢各位投资者对本产品的认可和投资。个人过往曾在多家财富管理机构从事基金产品研究、投资组合管理工作，见证了大量投资者在市场波动时无法承受产品回撤而选择赎回基金，造成最终客户投资收益与基金产品收益差异巨大的情形，因此为了尽可能帮助投资者能够做到长期投资，实现基金产品收益和投资者实际收益相匹配并满足客户投资产品时的初心，本产品以追求在相对较小波动下的长期稳健收益为核心投资目标，希望能够通过大类资产配置、基金优选、风险管理等相关工作，降低基金产品的回撤和波动，尽量让投资者能够在可接受的波动环境下，长期持有本产品，并获得稳健回报。

本产品自成立后已运行 3 个半月，在产品成立后的这段时间内，资本市场出现了一定变化，产品成立初期，市场演绎出类滞涨的经济特征，9 月下旬至 10 月中旬，股债双杀，10 年国债收益率一度突破 3.0 关口，随后在上游价格逐步回落的背景下，市场对“胀”的担忧有所减退，转而更加关注“滞”，进入 10 月中旬后，在 PMI 数据不及预期的背景下，大家普遍对经济衰退有所担忧，货币紧张环境逐步缓解，债券利率持续下行，债券基金快速上涨，而在衰退环境下，由于政策持续托底，信用环境有所企稳，因此权益市场并未出现系统性持续调整，反而持续结构性行情和震荡走势，在这种环境下优质的偏股基金获得了一定的超额收益，进入 12 月之后，随着年底时点的临近，不少机构投资者开始进行风格及行业的动态调整，权益市场波动有所加大，热点也并不清晰，前期上涨较多的新能源等板块连续调整，而消费等板块在持续调整后得到一部分资金的关注，从权益基金整体表现看，趋于更加均衡。

产品成立时恰逢权益市场处于高位，在权益市场震荡下行期间，组合整体建仓节奏较稳健，对于权益基金、偏债类品种的建仓节奏相对均衡，其中 10 月中旬前，组合在短债和中长期债券基金上维持了相对均衡的配置，组合的回撤幅度可控，随着权益市场逐步调整，逐步增加权益资产的配置比例，伴随着权益市场震荡环境，底层多数优质的权益基金获得了比较稳健的收益。同时随着债券利率的下行，债券基金稳步上涨，并逐步增加债券基金配置比例，截止年底，组合纯债类品种在 50% 左右，此类产品相对分散，尽量降低未来可能出现信用风险事件对底层债基以及本产品的影响，在这部分持仓中，组合持有了不少公司内部基金，一方面是公司内部的纯债类品种整体表现较为优异，另一方面配置于公司内部基金可以减免该部分资产的母基金管理费，尽可能降低投资者成本，提升客户投资体验；固收+品种的仓位在 30% 以上，大多数为具有一定回撤控

制能力且长期业绩比较稳定的产品，此类产品的配置上策略较为分散，尽量降低整体的共振性对组合造成较大波动；权益基金约为 8%，风格方面相对均衡，没有做出特别大的风格偏离；另有配置的股票占比在 1.7%左右，以偏大盘价值风格为主，主要用于积累底仓并适当参与打新。随着市场震荡，组合整体的配置结构较为合理和稳健，坚持着相对稳健均衡的配置思路，组合在持仓风格上仍较为分散，组合净值的表现相对较为平稳，但在进入 12 月之后，随着权益市场的阶段性调整，组合出现了一定的波动。临近年底时，我们对组合的配置进行了适度微调，首发参与的客户由于前期市场并不是特别理想，因此在短期内的收益率并没有特别高，但本基金继续秉承着稳健配置的思路，在目前的收益情况下，继续做好组合的平衡和风险防范，以控制权益仓位为主要的方式进行波动和下行风险的防范，待市场风格相对稳定和投资脉络清晰后，再继续提升权益仓位博取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）A 基金份额净值为 1.0107 元，本报告期份额净值增长率为 1.10%；华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）C 基金份额净值为 1.0096 元，本报告期份额净值增长率为 1.00%，同期业绩比较基准增长率为 0.82%。

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	60,038,899.60	1.67
	其中：股票	60,038,899.60	1.67
2	基金投资	3,288,436,391.94	91.45
3	固定收益投资	169,071,000.00	4.70
	其中：债券	169,071,000.00	4.70
	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	69,835,516.38	1.94
8	其他各项资产	8,469,734.64	0.24
9	合计	3,595,851,542.56	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	8,227,743.00	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,598,093.00	0.10
E	建筑业	5,170,213.80	0.14
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,891,760.00	0.19
H	住宿和餐饮业	380,900.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,179,045.00	0.06
J	金融业	31,130,999.00	0.87
K	房地产业	2,003,766.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	426,888.00	0.01
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	29,491.80	0.00
S	综合	-	-
	合计	60,038,899.60	1.67

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	601398	工商银行	2,403,200	11,126,816.00	0.31
2	601288	农业银行	2,708,900	7,964,166.00	0.22
3	601939	建设银行	1,315,000	7,705,900.00	0.21
4	601006	大秦铁路	951,300	6,088,320.00	0.17
5	601668	中国建筑	1,033,100	5,165,500.00	0.14
6	600900	长江电力	124,000	2,814,800.00	0.08
7	600519	贵州茅台	1,200	2,460,000.00	0.07
8	601688	华泰证券	130,500	2,317,680.00	0.06
9	600048	保利发展	128,200	2,003,766.00	0.06
10	600031	三一重工	65,400	1,491,120.00	0.04

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	169,071,000.00	4.70
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	169,071,000.00	4.70

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	219948	21 贴现国债 48	1,000,000	98,910,000.00	2.75

2	190011	19 附息国债 11	700,000	70,161,000.00	1.95
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	15,096.94

2	应收证券清算款	7,072,001.70
3	应收股利	-
4	应收利息	1,261,436.72
5	应收申购款	121,199.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,469,734.64

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	004042	华夏鼎茂债券 A	契约型开放式	220,419,812.88	262,828,584.88	7.31	是
2	004672	华夏短债债券 A	契约型开放式	239,152,776.42	242,261,762.51	6.74	是
3	006668	华夏中短债债券 A	契约型开放式	214,779,299.66	227,365,366.62	6.33	是
4	000186	华泰柏瑞季季红债券	契约型开放式	126,862,761.50	136,098,370.54	3.79	否
5	100018	富国天利增长债券	契约型开放式	80,970,273.49	111,763,268.50	3.11	否
6	530021	建信纯债	契约型开	72,385,855.53	108,441,250.17	3.02	否

		债券 A	放式				
7	000015	华夏纯债债券 A	契约型开放式	74,616,204.46	93,344,871.78	2.60	是
8	013391	招商安泰债券 D	契约型开放式	71,796,566.27	91,181,639.16	2.54	否
9	000385	景顺长城景颐双利债券 A	契约型开放式	57,537,407.27	90,678,953.86	2.52	否
10	008791	招商安华债券 A	契约型开放式	74,354,870.56	82,883,374.21	2.31	否

注：报告期末本基金持有招商基金管理有限公司管理的基金，招商基金管理有限公司为本基金托管人招商银行股份有限公司的重大关联方。

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）	69,517.94	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	701,320.78	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	117,715.31	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	3,913,024.54	671,085.55
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,036,562.86	256,756.48
当期交易基金产生的交易费（元）	906.88	567.13

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	华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）A	华夏聚鑫优选六个月持有混合（FOF）C
本报告期期初基金份额总额	2,381,551,668.10	1,137,641,858.03
报告期期间基金总申购份额	34,589,327.95	2,884,509.06
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	2,416,140,996.05	1,140,526,367.09

§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

2021 年 10 月 15 日发布华夏聚鑫优选六个月持有期混合型基金中基金(FOF)开放日常申购、赎回、定期定额申购业务的公告。

2021 年 11 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。

2021 年 12 月 10 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，首批公募 MOM 基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，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、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 12 月 31 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 1/35；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 1/176、华夏兴华混合（A 类）排序第 32/176；在定期开放式偏股型基金（A 类）中华夏磐利一年定开混合（A 类）排序第 1/63、华夏成长精选 6 个月定开混合（A 类）排序第 17/63；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 2/692、华夏盛世混合排序第 14/692；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 6/33；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 10/132；在标准股票型基金（A 类）中华夏智胜价值成长股票（A 类）排序第 41/259；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 79/499。

指数与量化策略产品：在信用债指数债券型基金（A 类）中华夏亚债中国指数（A 类）排序第 2/18；在策略指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏创成长 ETF 联接（A 类）排序第 3/14；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 4/103；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 4/95、华夏中证四川国改 ETF 排序第 7/95、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 10/95；在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 5/23；在主题指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证四川国改 ETF 联接（A 类）排序第 5/55、华夏国证半导体芯片 ETF 联接（A 类）排序第 7/55；在定期开放式绝对收益目标基金（A 类）中华夏安泰对冲策略

3 个月定开混合排序第 5/24；在行业指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A 类)排序第 7/27、华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排序第 8/27；在利率债指数债券型基金（A 类）中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 8/103；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 10/42、；在规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证 500ETF 联接(A 类)排序第 13/75；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 500ETF 排序第 16/113、华夏创业板 ETF 排序第 22/113。

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 4/25；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 4/231、华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排序第 20/231、华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 26/231、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 29/231、华夏睿磐泰兴混合排序第 34/231；在长期纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎航债券(A 类)排序第 29/615、华夏鼎茂债券(A 类)排序第 85/615；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A 类)排序第 8/54；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏聚利债券排序第 14/203、华夏双债债券(A 类)排序第 32/203；在普通债券型基金（二级）(A 类）中华夏鼎泓债券(A 类)排序第 31/258；在定期开放式纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎瑞三个月定期开放债券(A 类)排序第 80/427。

养老&FOF 产品：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 1/16、华夏聚惠 FOF(A 类)排序第 3/16；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 2/11。

在客户服务方面，4 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）华夏基金直销上线交通银行卡快捷支付业务，交易额度进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端上线非活期通基金的预约赎回功能，增加客户操作便利性；（3）与排排网基金销售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“披荆斩棘的投资人”、“华夏亲子财商营”、“定投的良辰吉日”等活动，为客户提供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、《华夏聚鑫优选六个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《华夏聚鑫优选六个月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

二〇二二年一月二十一日