

**华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式
证券投资基金
2021 年中期报告
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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

§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 2021 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 2021 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.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
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.....	51
§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.....	55
§12 备查文件目录.....	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金	
基金简称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数	
基金主代码	007505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 7 月 16 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	150,270,339.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
下属分级基金的交易代码	007505	007506
报告期末下属分级基金的份额总额	63,284,276.98 份	86,986,062.23 份

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	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略等。
业绩比较基准	中证华夏 AH 经济蓝筹股票指数收益率×95%+中国人民银行公布的人民币活期存款利率×5%。
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，属于中高风险品种。 基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

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	秦一楠
	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	谷澍

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	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
本期已实现收益	2,268,556.43	4,417,527.90
本期利润	2,588,852.43	5,282,655.45
加权平均基金份额本期利润	0.0949	0.0947
本期加权平均净值利润率	6.97%	6.99%
本期基金份额净值增长率	8.09%	7.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
期末可供分配利润	15,278,015.15	20,328,981.12
期末可供分配基金份额利润	0.2414	0.2337
期末基金资产净值	87,739,790.10	119,893,394.11
期末基金份额净值	1.3864	1.3783
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
基金份额累计净值增长率	38.64%	37.83%

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

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

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	1.24%	0.60%	-2.86%	0.56%	4.10%	0.04%
过去三个月	3.35%	0.69%	-1.43%	0.69%	4.78%	0.00%
过去六个月	8.09%	1.04%	3.13%	1.05%	4.96%	-0.01%
过去一年	24.64%	1.10%	16.73%	1.09%	7.91%	0.01%
自基金合同生效起至今	38.64%	1.13%	25.68%	1.12%	12.96%	0.01%

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

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	1.22%	0.61%	-2.86%	0.56%	4.08%	0.05%
过去三个月	3.27%	0.69%	-1.43%	0.69%	4.70%	0.00%
过去六个月	7.94%	1.04%	3.13%	1.05%	4.81%	-0.01%
过去一年	24.27%	1.10%	16.73%	1.09%	7.54%	0.01%
自基金合同生效起至今	37.83%	1.13%	25.68%	1.12%	12.15%	0.01%

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 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

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

(2019 年 7 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日)

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A



华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C



§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《上海证券报》主办的第十八届“金基金”奖评选活动上, 华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报, 荣膺四大奖项: 公司层面, 华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”; 产品层面, 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, 2021 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上线理财小管家和微信登录等功能, 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; (2) 华夏基金公众号上线选基助

手微信小程序，包含花样选基、目标选基、我的实验田等 5 大功能模块，帮助客户进行产品筛选；

(3) 与民商基金销售、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“都 2021 年了，你还要自己记么？”、“震荡市需要口服镇心丸”、“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。

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		
荣膺	本基金的基金经理、投委会成员	2020-12-08	-	11 年	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（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。

4.2 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 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 41 次，其中 20 次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，其余 21 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

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华夏中证 AH 经济蓝筹指数，中证华夏 AH 经济蓝筹股票指数从沪深 A 股以及符合港股通资格的港股中分行业选取一定数量财务基本面良好的蓝筹股票作为指数成份股，行业权重根据各行业对国民经济的贡献度进行分配，行业内个股根据财务基本面综合得分加权，以综合反映国民经济产业结构变迁及发展趋势。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，各国加快推进疫苗接种，疫情对经济的边际影响逐步减弱，世界经济趋于好转，但各国疫情时有反复，加上新型变种的出现，形势依然复杂严峻。美国大规模财政刺激与货币宽松共振使得市场的关注点迅速从通缩转向通胀，美债收益率对经济复苏预期予以了反应，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，过多数委员预测 2023 年底前可能会加息两次；欧洲国家疫情反复，欧洲央行维持再融资利率、存款利率、边际贷款利率不变，符合市场预期；日本央行坚持实施更有效和可持续的货币宽松政策，日元略有贬值。

国内方面，上半年经济运行延续稳定恢复态势，社融信贷增速虽同比下降，但经济仍显活力，在生产需求持续恢复、就业物价总体稳定的同时，创新驱动战略实施成效继续显现，高技术产业发展向好，新业态持续保持迅猛发展态势；海外输入型通胀隐忧随着 5 月经济数据的落定有所缓解，政策稳定性凸显，流动性整体维持相对宽松。

市场方面，A 股主要股指开年全线上扬，并在春节前步步走高；春节后，在经济复苏预期下，全球资金利率明显上行，全球资本市场波动共振加剧，A 股市场一些对资金利率较为敏感的板块出现较大幅度的调整。2 季度企稳后，市场震荡向上，个股板块分化，但总体韧性较强。受“碳达峰、碳中和”政策逐步落地、全球芯片短缺加剧等利好因素的催化，电气设备、汽车、电子这几个 1 季度跌幅较大的成长板块涨幅靠前，突破或接近去年以来的新高；采掘、化工、有色等板块也延续了 1 季度的相对强势；医药生物、国防军工、食品饮料等板块也实现了回调后的反弹；休闲服务、房地产、家用电器以及农林牧渔板块表现则相对弱势。中国香港市场同时受到境外发达市场和 A 股市场的影响，年初在盈利回升、低估值优势以及南下资金持续流入等因素推动下，出现较大幅度上涨，之后受到美国政策收紧预期及互联网行业反垄断的影响，部分互联网龙头企业出现了较大波动，带动香港市场出现一定的回调。

基金投资运作方面，报告期内，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，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 基金份额净值为 1.3864 元，本报告期份额净值增长率为 8.09%；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 基金份额净值为 1.3783 元，本报告期份额净值增长率为 7.94%，同期业绩比较基准增长率为 3.13%。

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，随着新冠疫苗全球逐步普及，全球经济或将延续稳步复苏态势，美国上半年的通货膨胀超预期，美联储维持当前宽松货币政策的压力增加，但后续政策收紧压力一定程度上已被市场预期，对经济和货币相对强势的中国市场或影响有限。国内方面，经济增长保持在较高水平，经济同比增速或将下降，货币、信贷政策收紧预期得到一定缓解，新经济板块仍获得国家政策支持。与全球主要市场对比，中国香港市场在本轮调整后估值优势重新体现，但若美国市场大幅波动或互联网行业反垄断超预期，也会增加中国香港市场波动。

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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《中华人民共和国证券投资基金法》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的真实、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 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	23,883,334.41	7,678,224.20
结算备付金		3,569,732.86	38,374.53
存出保证金		234,051.76	8,802.29
交易性金融资产	6.4.7.2	168,775,743.29	99,508,654.64
其中：股票投资		168,673,673.29	99,402,654.64
基金投资		-	-
债券投资		102,070.00	106,000.00
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		158,316.16	969,760.07
应收利息	6.4.7.5	4,693.73	1,775.32
应收股利		408,483.63	13,852.77
应收申购款		39,362,140.36	235,847.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		236,396,496.20	108,455,291.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		23,566,785.26	0.28
应付赎回款		4,963,839.13	1,753,587.51
应付管理人报酬		48,086.99	44,633.73
应付托管费		9,617.41	8,926.75
应付销售服务费		19,446.44	17,617.67
应付交易费用	6.4.7.7	61,025.26	27,006.91
应交税费		-	0.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	94,511.50	141,241.23
负债合计		28,763,311.99	1,993,014.28
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	150,270,339.21	83,250,997.15
未分配利润	6.4.7.10	57,362,845.00	23,211,279.88

所有者权益合计		207,633,184.21	106,462,277.03
负债和所有者权益总计		236,396,496.20	108,455,291.31

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 基金份额净值 1.3864 元，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 基金份额净值 1.3783 元；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数基金份额总额 150,270,339.21 份（其中 A 类 63,284,276.98 份，C 类 86,986,062.23 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		8,558,003.52	4,058,742.14
1.利息收入		33,144.93	18,861.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	33,075.41	18,711.84
债券利息收入		69.52	149.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,249,224.85	5,633,637.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,178,259.44	4,726,644.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,857.44	6,766.70
资产支持证券投资收益	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	-205,260.00	-
股利收益	6.4.7.17	1,272,367.97	900,226.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,185,423.55	-1,599,919.50
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	90,210.19	6,162.87
减：二、费用		686,495.64	469,178.64
1.管理人报酬		279,494.70	189,320.56
2.托管费		55,898.90	37,864.13
3.销售服务费		112,530.79	64,358.83
4.交易费用	6.4.7.20	129,613.01	88,592.76
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.03	-

7.其他费用	6.4.7.21	108,958.21	89,042.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,871,507.88	3,589,563.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,871,507.88	3,589,563.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	83,250,997.15	23,211,279.88	106,462,277.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,871,507.88	7,871,507.88
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）	67,019,342.06	26,280,057.24	93,299,399.30
其中：1.基金申购款	119,411,956.97	44,871,544.11	164,283,501.08
2.基金赎回款	-52,392,614.91	-18,591,486.87	-70,984,101.78
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）	150,270,339.21	57,362,845.00	207,633,184.21
项目	上年度可比期间 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）	90,830,786.77	4,523,176.09	95,353,962.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,589,563.50	3,589,563.50
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）	-28,094,144.24	-1,178,337.33	-29,272,481.57
其中：1.基金申购款	23,750,989.26	41,326.48	23,792,315.74
2.基金赎回款	-51,845,133.50	-1,219,663.81	-53,064,797.31
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）	62,736,642.53	6,934,402.26	69,671,044.79

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 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金（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[2019]938 号《关于准予华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式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 AH 经济蓝筹股票指数发起式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。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2019 年 6 月 3 日至 2019 年 7 月 12 日共募集 124,317,926.68 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（2019）验字第 60739337_A55 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 7 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 124,384,327.63 份基金份额，其中认购资金利息折合 66,400.95 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、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券以及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	23,883,334.41
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	23,883,334.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	159,413,685.43	168,673,673.29	9,259,987.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	102,080.00	102,070.00
	银行间市场	-	-
	合计	102,080.00	102,070.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	159,515,765.43	168,775,743.29	9,259,977.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,703.63
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	914.96
应收债券利息	1,072.04
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	-
其他	3.10
合计	4,693.73

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	61,025.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	61,025.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	208.94
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	10,000.00
合计	94,511.50

6.4.7.9 实收基金

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	27,663,098.16	27,663,098.16
本期申购	45,271,960.40	45,271,960.40
本期赎回（以“-”号填列）	-9,650,781.58	-9,650,781.58

本期末	63,284,276.98	63,284,276.98
-----	---------------	---------------

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	55,587,898.99	55,587,898.99
本期申购	74,139,996.57	74,139,996.57
本期赎回（以“-”号填列）	-42,741,833.33	-42,741,833.33
本期末	86,986,062.23	86,986,062.23

6.4.7.10 未分配利润

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

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	4,406,221.68	3,410,080.16	7,816,301.84
本期利润	2,268,556.43	320,296.00	2,588,852.43
本期基金份额交易产生的变动数	8,603,237.04	5,447,121.81	14,050,358.85
其中：基金申购款	10,487,856.49	7,073,716.35	17,561,572.84
基金赎回款	-1,884,619.45	-1,626,594.54	-3,511,213.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,278,015.15	9,177,497.97	24,455,513.12

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

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	8,563,411.31	6,831,566.73	15,394,978.04
本期利润	4,417,527.90	865,127.55	5,282,655.45
本期基金份额交易产生的变动数	7,348,041.91	4,881,656.48	12,229,698.39
其中：基金申购款	14,770,461.51	12,539,509.76	27,309,971.27
基金赎回款	-7,422,419.60	-7,657,853.28	-15,080,272.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,328,981.12	12,578,350.76	32,907,331.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	活期存款利息收入	28,206.51
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	4,737.36
其他	131.54
合计	33,075.41

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	34,770,061.06
减：卖出股票成本总额	28,591,801.62
买卖股票差价收入	6,178,259.44

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	195,882.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	192,000.00
减：应收利息总额	24.84
买卖债券差价收入	3,857.44

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	-205,260.00
合计	-205,260.00

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,272,367.97
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,272,367.97

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	1,185,423.55
——股票投资	1,185,433.55
——债券投资	-10.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.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	1,185,423.55

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	90,210.19
合计	90,210.19

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	129,613.01
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	129,613.01

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,655.65
指数使用费	20,000.00
合计	108,958.21

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
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人股东控股的公司

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	113,979,590.92	89.63%	1,722,272.55	2.56%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中信证券	275,764.58	72.20%	-	-

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 2021年1月1日至2021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	50,845.04	90.17%	47,061.17	77.12%
关联方名称	上年度可比期间 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	742.85	3.29%	742.85	2.21%

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	279,494.70	189,320.56
其中：支付销售机构的客户维护费	89,871.21	49,413.82

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 0.50% 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 × 0.50% / 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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	55,898.90	37,864.13

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 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	4,311.13	4,311.13
中信证券	-	133.37	133.37
华夏财富	-	14.05	14.05
中信证券（华南）	-	6.70	6.70

合计	-	4,465.25	4,465.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证AH经济蓝筹股票指数A	华夏中证AH经济蓝筹股票指数C	合计
华夏基金管理有限公司	-	3,028.66	3,028.66
华夏财富	-	42.05	42.05
中信证券	-	8.98	8.98
合计	-	3,079.69	3,079.69

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 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

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	华夏中证AH经济蓝筹股票指数A	华夏中证AH经济蓝筹股票指数C	华夏中证AH经济蓝筹股票指数A	华夏中证AH经济蓝筹股票指数C
期初持有的基金份额	10,002,444.69	-	10,002,444.69	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-

期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,002,444.69	-	10,002,444.69	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.81%	-	35.15%	-

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

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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
中信证券	2,915,451.90	3.35%	-	-

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	23,883,334.41	28,206.51	3,965,474.30	17,067.46

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 2021年1月1日至2021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	600905	三峡能源	网下申购	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88

中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28
中信证券	688425	铁建重工	网上申购	500	1,435.00
上年度可比期间 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
-	-	-	-	-	-

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

于 2021 年 6 月 30 日, 本基金持有的中信证券股票估值总额为人民币 638,464.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.15%(2020 年 12 月 31 日, 本基金持有的中信证券股票估值总额为人民币 467,460.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.22%)。

于 2021 年 6 月 30 日, 本基金持有的农业银行股票估值总额为人民币 464,499.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.11%(2020 年 12 月 31 日, 本基金持有的农业银行股票估值总额为人民币 270,040.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.13%)。

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(2021 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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新发流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-

6.4.12.1.2 受限证券类别: 债券

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: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	新发流通受限	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

⑥以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600093	*ST 易见	2021-05-06	重大事项	5.93	2021-07-07	5.63	2,900	24,352.02	17,197.00	-

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

无。

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內。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	23,883,334.41	-	-	23,883,334.41
结算备付金	3,569,732.86	-	-	3,569,732.86
结算保证金	234,051.76	-	-	234,051.76
债券投资	102,070.00	-	-	102,070.00
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	利率下降 25 个基点	139.00	-
	利率上升 25 个基点	-138.74	-

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-

交易性金融资产	-	51,130,708.91	-	51,130,708.91
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	408,483.63	-	408,483.63
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	51,539,192.54	-	51,539,192.54
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	35,099,847.04	-	35,099,847.04
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	13,852.77	-	13,852.77
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	35,113,699.81	-	35,113,699.81
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	港币相对人民币升值 5%	2,576,959.63	1,755,684.99
	港币相对人民币贬值 5%	-2,576,959.63	-1,755,684.99

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	168,673,673.29	81.24	99,402,654.64	93.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,000.00	0.00	106,000.00	0.10
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	168,675,673.29	81.24	99,508,654.64	93.47

注：①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。

②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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证华夏 AH 经济蓝筹股票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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	-5%	-8,496,620.82	-5,346,860.58
	+5%	8,496,620.82	5,346,860.58

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 2021 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 163,528,657.08 元，第二层次的余额为 5,247,086.21 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2020 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 99,508,654.64 元，第二层次的余额为 0 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(包括涨跌停时的交易不活跃)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	168,673,673.29	71.35
	其中：股票	168,673,673.29	71.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	102,070.00	0.04
	其中：债券	102,070.00	0.04
	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	27,453,067.27	11.61
8	其他各项资产	40,167,685.64	16.99
9	合计	236,396,496.20	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 51,130,708.91 元，占基金资产净值比例为 24.63%。

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	2,950,037.20	1.42
B	采矿业	3,901,036.44	1.88
C	制造业	46,233,481.73	22.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,296,725.21	4.00
E	建筑业	10,752,874.00	5.18
F	批发和零售业	13,532,533.28	6.52
G	交通运输、仓储和邮政业	4,299,619.90	2.07
H	住宿和餐饮业	489,770.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,574,616.80	1.24
J	金融业	13,579,442.30	6.54
K	房地产业	6,161,011.00	2.97
L	租赁和商务服务业	3,321,650.00	1.60
M	科学研究和技术服务业	563,371.08	0.27
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	83,560.00	0.04
Q	卫生和社会工作	97,810.44	0.05
R	文化、体育和娱乐业	705,425.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	117,542,964.38	56.61

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	17,859,856.65	8.60
非必需消费品	9,942,656.23	4.79
房地产	4,588,588.37	2.21
必需消费品	4,004,742.78	1.93
保健	3,793,452.23	1.83
工业	3,487,014.29	1.68
材料	3,301,212.49	1.59
信息技术	2,197,090.61	1.06
公用事业	1,117,758.02	0.54
能源	705,337.57	0.34
金融	132,999.67	0.06
合计	51,130,708.91	24.63

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	00700	腾讯控股	34,100	16,570,373.95	7.98
2	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	2.48
3	03690	美团-W	18,000	4,798,771.78	2.31
4	601939	建设银行	652,800	4,341,120.00	2.09
5	600519	贵州茅台	1,500	3,085,050.00	1.49
6	600887	伊利股份	80,900	2,979,547.00	1.44
7	601318	中国平安	43,500	2,796,180.00	1.35
8	601668	中国建筑	592,500	2,755,125.00	1.33
9	000002	万科A	109,800	2,614,338.00	1.26
10	03323	中国建材	316,000	2,397,988.00	1.15
11	000858	五粮液	6,700	1,995,863.00	0.96
12	601390	中国中铁	371,300	1,945,612.00	0.94
13	300498	温氏股份	121,320	1,743,368.40	0.84
14	00267	中信股份	247,000	1,720,233.87	0.83
15	01099	国药控股	83,600	1,606,879.62	0.77
16	601888	中国中免	5,200	1,560,520.00	0.75
17	601186	中国铁建	209,600	1,557,328.00	0.75

18	02319	蒙牛乳业	38,000	1,484,513.92	0.71
19	600655	豫园股份	125,200	1,451,068.00	0.70
20	601919	中远海控	47,000	1,435,380.00	0.69
21	600028	中国石化	309,400	1,348,984.00	0.65
22	000338	潍柴动力	72,700	1,299,149.00	0.63
23	000333	美的集团	18,200	1,298,934.00	0.63
24	600585	海螺水泥	31,200	1,280,760.00	0.62
25	600036	招商银行	23,600	1,278,884.00	0.62
26	600048	保利地产	105,900	1,275,036.00	0.61
27	002714	牧原股份	19,840	1,206,668.80	0.58
28	002416	爱施德	117,900	1,182,537.00	0.57
29	06110	滔搏	110,000	1,164,246.34	0.56
30	601669	中国电建	294,700	1,140,489.00	0.55
31	002251	步步高	147,600	1,086,336.00	0.52
32	600019	宝钢股份	140,600	1,074,184.00	0.52
33	01918	融创中国	48,000	1,064,396.74	0.51
34	600104	上汽集团	48,300	1,061,151.00	0.51
35	600153	建发股份	129,300	1,047,330.00	0.50
36	000651	格力电器	20,000	1,042,000.00	0.50
37	00493	国美零售	1,239,000	1,030,947.12	0.50
38	601398	工商银行	188,000	971,960.00	0.47
39	000876	新希望	66,200	971,154.00	0.47
40	601607	上海医药	44,700	944,511.00	0.45
41	01109	华润置地	36,000	942,080.98	0.45
42	300226	上海钢联	15,360	914,688.00	0.44
43	600729	重庆百货	32,900	903,105.00	0.43
44	601766	中国中车	148,000	899,840.00	0.43
45	601857	中国石油	162,200	858,038.00	0.41
46	000829	天音控股	103,400	852,016.00	0.41
47	600050	中国联通	187,300	809,136.00	0.39
48	600859	王府井	27,900	805,752.00	0.39
49	601800	中国交建	123,700	801,576.00	0.39
50	000725	京东方 A	127,500	795,600.00	0.38
51	601618	中国中冶	265,200	790,296.00	0.38
52	02007	碧桂园	109,000	789,061.46	0.38
53	600606	绿地控股	137,500	749,375.00	0.36
54	00322	康师傅控股	58,000	748,039.92	0.36
55	002419	天虹股份	114,000	747,840.00	0.36
56	600704	物产中大	93,000	731,910.00	0.35
57	600690	海尔智家	27,300	707,343.00	0.34
58	600325	华发股份	104,800	706,352.00	0.34
59	00883	中国海洋石油	96,000	705,337.57	0.34
60	002594	比亚迪	2,800	702,800.00	0.34

61	300750	宁德时代	1,300	695,240.00	0.33
62	00941	中国移动	17,000	686,757.23	0.33
63	600031	三一重工	23,400	680,238.00	0.33
64	01958	北京汽车	280,000	673,319.14	0.32
65	09633	农夫山泉	20,600	667,636.03	0.32
66	601899	紫金矿业	67,700	656,013.00	0.32
67	600694	大商股份	31,500	653,940.00	0.31
68	002304	洋河股份	3,100	642,320.00	0.31
69	600030	中信证券	25,600	638,464.00	0.31
70	601600	中国铝业	112,300	595,190.00	0.29
71	00688	中国海外发展	40,000	587,115.64	0.28
72	601006	大秦铁路	86,500	569,170.00	0.27
73	600011	华能国际	134,000	565,480.00	0.27
74	600900	长江电力	27,300	563,472.00	0.27
75	00788	中国铁塔	628,000	559,124.48	0.27
76	600795	国电电力	229,100	556,713.00	0.27
77	000039	中集集团	29,900	543,582.00	0.26
78	00960	龙湖集团	15,000	542,932.20	0.26
79	00992	联想集团	72,000	534,994.16	0.26
80	600309	万华化学	4,900	533,218.00	0.26
81	600068	葛洲坝	70,000	524,300.00	0.25
82	000568	泸州老窖	2,200	519,068.00	0.25
83	600276	恒瑞医药	7,564	514,125.08	0.25
84	600089	特变电工	39,800	511,430.00	0.25
85	601088	中国神华	26,200	511,424.00	0.25
86	600057	厦门象屿	80,800	505,000.00	0.24
87	600837	海通证券	43,500	500,250.00	0.24
88	600362	江西铜业	22,200	496,836.00	0.24
89	06808	高鑫零售	102,000	490,561.08	0.24
90	600754	锦江酒店	8,600	489,770.00	0.24
91	601988	中国银行	158,100	486,948.00	0.23
92	601012	隆基股份	5,440	483,289.60	0.23
93	000895	双汇发展	15,100	480,180.00	0.23
94	601992	金隅集团	177,100	476,399.00	0.23
95	600196	复星医药	6,600	476,058.00	0.23
96	002352	顺丰控股	6,900	467,130.00	0.22
97	001979	招商蛇口	42,600	466,470.00	0.22
98	601288	农业银行	153,300	464,499.00	0.22
99	00291	华润啤酒	8,000	464,300.64	0.22
100	000100	TCL 科技	58,700	449,055.00	0.22
101	601933	永辉超市	92,000	435,160.00	0.21
102	600755	厦门国贸	52,300	429,383.00	0.21
103	01093	石药集团	44,560	416,750.93	0.20

104	00175	吉利汽车	20,000	406,887.12	0.20
105	002092	中泰化学	39,300	403,611.00	0.19
106	601117	中国化学	45,700	400,332.00	0.19
107	03320	华润医药	96,000	386,617.65	0.19
108	03800	保利协鑫能源	232,000	382,224.27	0.18
109	601688	华泰证券	24,000	379,200.00	0.18
110	00981	中芯国际	19,000	377,847.53	0.18
111	600741	华域汽车	14,200	373,034.00	0.18
112	01177	中国生物制药	58,000	367,746.08	0.18
113	000709	河钢股份	147,400	362,604.00	0.17
114	600170	上海建工	128,900	355,764.00	0.17
115	601155	新城控股	8,400	349,440.00	0.17
116	00817	中国金茂	160,000	346,145.28	0.17
117	000157	中联重科	37,300	344,652.00	0.17
118	600332	白云山	10,100	341,885.00	0.16
119	601211	国泰君安	19,700	337,658.00	0.16
120	002202	金风科技	27,700	336,832.00	0.16
121	00780	同程艺龙	20,800	336,453.21	0.16
122	002027	分众传媒	35,500	334,055.00	0.16
123	000488	晨鸣纸业	39,200	319,088.00	0.15
124	000401	冀东水泥	25,700	317,395.00	0.15
125	00813	世茂集团	20,000	316,856.07	0.15
126	603259	药明康德	2,012	315,059.08	0.15
127	600346	恒力石化	12,000	314,880.00	0.15
128	600027	华电国际	90,700	312,008.00	0.15
129	600998	九州通	20,200	310,474.00	0.15
130	00489	东风集团股份	52,000	302,011.76	0.15
131	600808	马钢股份	68,800	295,152.00	0.14
132	003816	中国广核	110,200	294,234.00	0.14
133	000630	铜陵有色	106,900	290,768.00	0.14
134	601866	中远海发	76,500	286,875.00	0.14
135	02688	新奥能源	2,300	282,857.27	0.14
136	000425	徐工机械	44,000	280,280.00	0.13
137	600352	浙江龙盛	19,800	272,052.00	0.13
138	000898	鞍钢股份	59,700	265,665.00	0.13
139	03898	中车时代电气	6,900	263,528.06	0.13
140	002422	科伦药业	13,200	263,340.00	0.13
141	000825	太钢不锈	35,100	262,899.00	0.13
142	601233	桐昆股份	10,900	262,581.00	0.13
143	000963	华东医药	5,700	262,257.00	0.13
144	600010	包钢股份	167,100	259,005.00	0.12
145	600839	四川长虹	88,700	258,117.00	0.12
146	600438	通威股份	5,900	255,293.00	0.12

147	000932	华菱钢铁	38,200	252,120.00	0.12
148	600886	国投电力	26,100	250,821.00	0.12
149	000625	长安汽车	9,500	249,660.00	0.12
150	000938	紫光股份	11,360	248,556.80	0.12
151	01810	小米集团-W	11,000	247,127.76	0.12
152	03808	中国重汽	12,500	173,072.64	0.08
152	000951	中国重汽	2,700	73,062.00	0.04
153	300058	蓝色光标	40,500	245,025.00	0.12
154	601985	中国核电	48,200	243,892.00	0.12
155	000538	云南白药	2,100	243,012.00	0.12
156	00576	浙江沪杭甬	42,000	241,486.26	0.12
157	002183	怡亚通	41,900	240,087.00	0.12
158	00135	昆仑能源	40,000	238,307.71	0.11
159	002180	纳思达	7,400	238,280.00	0.11
160	601727	上海电气	55,600	235,744.00	0.11
161	600584	长电科技	6,200	233,616.00	0.11
162	300999	金龙鱼	2,700	229,392.00	0.11
163	600079	人福医药	8,000	226,160.00	0.11
164	600958	东方证券	22,300	222,777.00	0.11
165	002415	海康威视	3,400	219,300.00	0.11
166	600801	华新水泥	12,400	217,868.00	0.10
167	002493	荣盛石化	12,550	216,738.50	0.10
168	002001	新和成	7,460	213,952.80	0.10
169	600637	东方明珠	26,100	213,759.00	0.10
170	603993	洛阳钼业	40,900	211,044.00	0.10
171	603858	步长制药	9,240	207,807.60	0.10
172	00144	招商局港口	22,000	207,587.32	0.10
173	000776	广发证券	13,700	207,418.00	0.10
174	002475	立讯精密	4,490	206,540.00	0.10
175	600380	健康元	15,000	205,950.00	0.10
176	600782	新钢股份	36,800	205,344.00	0.10
177	600219	南山铝业	56,000	201,600.00	0.10
178	600535	天士力	13,600	201,416.00	0.10
179	600547	山东黄金	10,452	200,887.44	0.10
180	300677	英科医疗	1,600	199,680.00	0.10
181	601877	正泰电器	5,900	196,942.00	0.09
182	000063	中兴通讯	5,900	196,057.00	0.09
183	600282	南钢股份	54,100	192,596.00	0.09
184	000778	新兴铸管	51,700	192,324.00	0.09
185	300760	迈瑞医疗	400	192,020.00	0.09
186	600406	国电南瑞	8,260	191,962.40	0.09
187	600660	福耀玻璃	3,400	189,890.00	0.09
188	000703	恒逸石化	15,850	189,407.50	0.09

189	000028	国药一致	5,000	189,200.00	0.09
190	01378	中国宏桥	21,500	188,199.85	0.09
191	600999	招商证券	9,710	184,684.20	0.09
192	01313	华润水泥控股	30,000	184,222.51	0.09
193	600500	中化国际	23,260	182,823.60	0.09
194	600166	福田汽车	52,800	182,160.00	0.09
195	000959	首钢股份	32,100	180,402.00	0.09
196	000513	丽珠集团	3,600	180,072.00	0.09
197	00148	建滔集团	5,000	179,313.24	0.09
198	02269	药明生物	1,500	177,607.48	0.09
199	601598	中国外运	35,100	177,255.00	0.09
200	002271	东方雨虹	3,200	177,024.00	0.09
201	002241	歌尔股份	4,100	175,234.00	0.08
202	02689	玖龙纸业	21,000	174,037.86	0.08
203	600739	辽宁成大	8,300	172,723.00	0.08
204	002078	太阳纸业	12,900	172,215.00	0.08
205	000166	申万宏源	36,700	171,756.00	0.08
206	000878	云南铜业	13,300	170,639.00	0.08
207	00867	康哲药业	10,000	170,160.36	0.08
207	06862	海底捞	5,000	170,160.36	0.08
208	601991	大唐发电	64,300	169,752.00	0.08
209	002110	三钢闽光	25,000	168,500.00	0.08
210	03396	联想控股	15,500	164,568.79	0.08
211	600511	国药股份	4,900	161,994.00	0.08
212	600820	隧道股份	30,600	161,874.00	0.08
213	600056	中国医药	13,300	161,595.00	0.08
214	00152	深圳国际	18,000	160,857.70	0.08
215	00392	北京控股	7,000	160,466.63	0.08
216	00836	华润电力	18,000	158,760.87	0.08
217	02331	李宁	2,000	157,762.37	0.08
218	600710	苏美达	25,300	156,354.00	0.08
219	600373	中文传媒	15,800	155,788.00	0.08
220	01193	华润燃气	4,000	155,099.71	0.07
221	000830	鲁西化工	8,200	153,586.00	0.07
222	601633	长城汽车	3,500	152,565.00	0.07
223	601628	中国人寿	4,500	152,505.00	0.07
224	000999	华润三九	5,700	152,475.00	0.07
225	02020	安踏体育	1,000	152,104.22	0.07
226	600426	华鲁恒升	4,880	151,036.00	0.07
227	000960	锡业股份	9,400	150,682.00	0.07
228	002091	江苏国泰	16,400	149,240.00	0.07
229	600026	中远海能	23,900	147,224.00	0.07
230	000623	吉林敖东	9,500	147,155.00	0.07

231	02382	舜宇光学科技	700	142,934.70	0.07
232	300003	乐普医疗	4,400	141,328.00	0.07
233	600018	上港集团	29,300	139,761.00	0.07
234	00308	香港中旅	130,000	139,539.82	0.07
235	600023	浙能电力	38,000	139,460.00	0.07
236	600085	同仁堂	3,400	138,890.00	0.07
237	600546	山煤国际	19,300	138,574.00	0.07
238	00363	上海实业控股	14,000	133,498.91	0.06
239	01359	中国信达	108,000	132,999.67	0.06
240	02313	申洲国际	800	130,536.71	0.06
241	01044	恒安国际	3,000	129,804.48	0.06
242	000034	神州数码	5,900	128,915.00	0.06
243	603501	韦尔股份	400	128,800.00	0.06
244	600307	酒钢宏兴	55,500	128,760.00	0.06
245	600060	海信视像	7,600	128,440.00	0.06
246	002185	华天科技	8,300	127,737.00	0.06
247	002081	金螳螂	16,000	126,720.00	0.06
248	600039	四川路桥	19,800	124,146.00	0.06
249	600893	航发动力	2,300	122,337.00	0.06
250	00384	中国燃气	6,200	122,265.83	0.06
251	002120	韵达股份	9,030	122,175.90	0.06
252	600096	云天化	8,700	122,148.00	0.06
253	600062	华润双鹤	10,200	121,482.00	0.06
254	600233	圆通速递	12,100	121,121.00	0.06
255	01199	中远海运港口	24,000	121,017.72	0.06
256	01066	威高股份	8,000	120,618.32	0.06
257	02357	中航科工	28,000	119,752.95	0.06
258	600420	国药现代	12,000	118,200.00	0.06
259	00570	中国中药	26,000	115,093.30	0.06
260	600959	江苏有线	37,600	114,680.00	0.06
261	600489	中金黄金	13,300	114,646.00	0.06
262	600267	海正药业	7,600	114,380.00	0.06
263	601872	招商轮船	24,600	113,652.00	0.05
264	000977	浪潮信息	4,000	112,520.00	0.05
265	600986	浙文互联	26,700	112,140.00	0.05
266	300122	智飞生物	600	112,038.00	0.05
267	01530	三生制药	14,000	111,831.55	0.05
268	02128	中国联塑	7,000	111,598.57	0.05
269	600177	雅戈尔	16,500	108,735.00	0.05
270	01308	海丰国际	4,000	108,003.98	0.05
271	688009	中国通号	18,977	107,979.13	0.05
272	000717	韶钢松山	23,500	107,865.00	0.05
273	600582	天地科技	27,600	107,640.00	0.05

274	00881	中升控股	2,000	107,504.73	0.05
275	06618	京东健康	1,150	106,502.08	0.05
276	000921	海信家电	7,400	106,338.00	0.05
277	600521	华海药业	5,000	104,400.00	0.05
278	601658	邮储银行	20,700	103,914.00	0.05
279	002727	一心堂	3,100	102,641.00	0.05
280	601928	凤凰传媒	14,300	102,102.00	0.05
281	601000	唐山港	41,600	100,256.00	0.05
282	601018	宁波港	25,300	99,935.00	0.05
283	002010	传化智联	12,700	97,917.00	0.05
284	300015	爱尔眼科	1,378	97,810.44	0.05
285	601098	中南传媒	11,000	97,020.00	0.05
286	02018	瑞声科技	2,000	96,687.70	0.05
287	02186	绿叶制药	22,500	95,668.40	0.05
288	03933	联邦制药	18,000	95,406.29	0.05
289	002236	大华股份	4,500	94,950.00	0.05
290	601828	美凯龙	7,900	94,800.00	0.05
291	603883	老百姓	1,780	93,770.40	0.05
292	02314	理文造纸	19,000	93,434.26	0.04
293	600787	中储股份	17,500	93,275.00	0.04
294	601816	京沪高铁	17,500	92,575.00	0.04
295	00667	中国东方教育	9,000	91,362.38	0.04
296	000708	中信特钢	4,350	90,654.00	0.04
297	300413	芒果超媒	1,300	89,180.00	0.04
298	002252	上海莱士	11,900	89,131.00	0.04
299	002736	国信证券	8,200	88,150.00	0.04
300	00839	中教控股	6,000	86,469.75	0.04
301	300433	蓝思科技	2,900	85,289.00	0.04
302	002607	中公教育	4,000	83,560.00	0.04
303	300133	华策影视	14,000	82,880.00	0.04
304	601212	白银有色	31,600	82,476.00	0.04
305	000050	深天马 A	5,800	82,244.00	0.04
306	600037	歌华有线	8,500	81,685.00	0.04
307	688396	华润微	884	80,461.68	0.04
308	01208	五矿资源	28,000	79,679.98	0.04
309	603160	汇顶科技	600	77,778.00	0.04
310	600623	华谊集团	8,700	76,647.00	0.04
311	300012	华测检测	2,400	76,512.00	0.04
312	600566	济川药业	4,200	75,180.00	0.04
313	002156	通富微电	3,100	74,524.00	0.04
314	600271	航天信息	5,700	74,271.00	0.04
315	601880	辽港股份	43,200	73,872.00	0.04
316	601319	中国人保	12,400	73,532.00	0.04

317	603939	益丰药房	1,300	72,917.00	0.04
318	00512	远大医药	12,000	72,490.81	0.03
319	600058	五矿发展	9,100	71,708.00	0.03
320	01347	华虹半导体	2,000	71,392.46	0.03
321	00581	中国东方集团	34,000	71,009.70	0.03
322	03311	中国建筑国际	16,000	70,560.38	0.03
323	601881	中国银河	6,500	70,070.00	0.03
324	601611	中国核建	9,600	69,312.00	0.03
325	002468	申通快递	8,900	67,818.00	0.03
326	600703	三安光电	2,100	67,305.00	0.03
327	000950	重药控股	12,700	63,881.00	0.03
328	300284	苏交科	10,900	63,765.00	0.03
329	601138	工业富联	5,000	62,050.00	0.03
330	01333	中国忠旺	41,200	62,049.87	0.03
331	601003	柳钢股份	10,500	61,950.00	0.03
332	603233	大参林	1,208	61,740.88	0.03
333	01070	T C L 电子	16,000	61,640.49	0.03
334	002938	鹏鼎控股	1,700	60,996.00	0.03
335	600295	鄂尔多斯	3,300	59,037.00	0.03
336	002127	南极电商	6,000	58,620.00	0.03
337	000156	华数传媒	7,600	58,596.00	0.03
338	600612	老凤祥	1,100	58,267.00	0.03
339	002191	劲嘉股份	5,400	57,456.00	0.03
340	600398	海澜之家	7,900	57,196.00	0.03
341	603056	德邦股份	5,200	57,148.00	0.03
342	03692	翰森制药	2,000	56,581.44	0.03
343	000301	东方盛虹	2,700	56,430.00	0.03
344	00656	复星国际	6,000	55,815.93	0.03
345	603018	华设集团	6,980	55,491.00	0.03
346	603825	华扬联众	2,800	51,688.00	0.02
347	600415	小商品城	10,000	51,500.00	0.02
348	002115	三维通信	9,000	51,390.00	0.02
349	603899	晨光文具	600	50,736.00	0.02
350	00743	亚洲水泥(中国)	10,000	50,590.46	0.02
351	601801	皖新传媒	10,600	50,032.00	0.02
352	600025	华能水电	8,500	49,215.00	0.02
353	600831	广电网络	8,200	48,298.00	0.02
354	600315	上海家化	800	48,112.00	0.02
355	600051	宁波联合	7,200	47,952.00	0.02
356	600377	宁沪高速	4,800	46,848.00	0.02
357	600350	山东高速	7,500	46,125.00	0.02
358	300063	天龙集团	10,000	45,100.00	0.02
359	601066	中信建投	1,400	44,002.00	0.02

360	600150	中国船舶	2,600	42,926.00	0.02
361	601238	广汽集团	3,300	42,735.00	0.02
362	603833	欧派家居	300	42,588.00	0.02
363	601298	青岛港	6,800	42,024.00	0.02
364	002556	辉隆股份	3,800	41,230.00	0.02
365	601949	中国出版	6,400	40,640.00	0.02
366	002344	海宁皮城	8,700	35,409.00	0.02
367	601231	环旭电子	2,100	35,301.00	0.02
368	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
369	600299	安迪苏	2,700	32,292.00	0.02
370	600989	宝丰能源	2,300	31,464.00	0.02
371	002301	齐心集团	3,100	31,124.00	0.01
372	000061	农产品	5,600	30,912.00	0.01
373	601995	中金公司	500	30,750.00	0.01
374	300251	光线传媒	2,700	29,187.00	0.01
375	01060	阿里影业	30,000	26,959.39	0.01
376	01896	猫眼娱乐	2,600	26,436.85	0.01
377	002032	苏泊尔	400	25,516.00	0.01
378	300770	新媒股份	500	24,350.00	0.01
379	000062	深圳华强	1,400	23,674.00	0.01
380	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
381	601515	东风股份	3,600	22,536.00	0.01
382	601965	中国汽研	1,300	22,464.00	0.01
383	002117	东港股份	2,600	21,814.00	0.01
384	603195	公牛集团	100	20,200.00	0.01
385	03331	维达国际	1,000	19,886.71	0.01
386	600093	易见股份	2,900	17,197.00	0.01
387	300215	电科院	2,000	16,760.00	0.01
388	01860	汇量科技	2,000	16,641.60	0.01
389	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
390	002999	天禾股份	1,600	12,400.00	0.01
391	300888	稳健医疗	100	12,362.00	0.01
392	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
393	002967	广电计量	200	8,760.00	0.00
394	300805	电声股份	400	5,508.00	0.00
395	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
396	003013	地铁设计	200	4,560.00	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

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	00700	腾讯控股	7,813,236.73	7.34
2	600905	三峡能源	3,436,527.95	3.23
3	601939	建设银行	2,576,108.00	2.42
4	03690	美团-W	2,187,176.61	2.05
5	601318	中国平安	1,853,609.00	1.74
6	600887	伊利股份	1,835,313.00	1.72
7	601668	中国建筑	1,825,143.00	1.71
8	600519	贵州茅台	1,675,829.00	1.57
9	000002	万科A	1,562,091.92	1.47
10	600028	中国石化	1,389,514.00	1.31
11	601390	中国中铁	1,254,094.00	1.18
12	002416	爱施德	1,174,849.00	1.10
13	300498	温氏股份	1,136,460.86	1.07
14	000858	五粮液	1,064,913.00	1.00
15	03323	中国建材	1,055,836.65	0.99
16	600048	保利地产	919,583.00	0.86
17	601186	中国铁建	912,240.00	0.86
18	601888	中国中免	865,148.00	0.81
19	601857	中国石油	850,522.00	0.80
20	600655	豫园股份	830,903.00	0.78

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	600905	三峡能源	1,722,374.00	1.62
2	00700	腾讯控股	1,660,387.90	1.56
3	600655	豫园股份	805,533.00	0.76
4	03333	中国恒大	770,479.74	0.72
5	600519	贵州茅台	660,108.00	0.62
6	601939	建设银行	525,514.00	0.49
7	03690	美团-W	514,456.88	0.48
8	601919	中远海控	502,355.00	0.47
9	601888	中国中免	486,144.00	0.46
10	600438	通威股份	422,148.00	0.40
11	600600	青岛啤酒	411,351.00	0.39
12	600887	伊利股份	397,843.00	0.37
13	000002	万科A	386,425.00	0.36
14	601318	中国平安	375,343.00	0.35
15	00916	龙源电力	364,974.29	0.34

16	600019	宝钢股份	363,036.00	0.34
17	00151	中国旺旺	339,412.55	0.32
18	601766	中国中车	319,423.00	0.30
19	000338	潍柴动力	285,708.00	0.27
20	03323	中国建材	284,316.24	0.27

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	96,677,386.72
卖出股票的收入（成交）总额	34,770,061.06

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	100,070.00	0.05
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）	2,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	102,070.00	0.05

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019649	21 国债 01	1,000	100,070.00	0.05
2	113049	长汽转债	20	2,000.00	0.00
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 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。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设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。本基金为指数型基金，主要采取复制策略，建设银行系标的指数成份股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	234,051.76
2	应收证券清算款	158,316.16
3	应收股利	408,483.63
4	应收利息	4,693.73
5	应收申购款	39,362,140.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	40,167,685.64
---	----	---------------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	2.48	新发流通受限

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

份额级别	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	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	2,160	29,298.28	46,724,756.88	73.83%	16,559,520.10	26.17%
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	19,713	4,412.62	35,400,311.89	40.70%	51,585,750.34	59.30%
合计	21,873	6,870.13	82,125,068.77	54.65%	68,145,270.44	45.35%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	408,732.68	0.65%
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	65,913.37	0.08%
	合计	474,646.05	0.32%

8.3 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	份额级别	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负责	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	10~50

人持有本开放式基金	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	0
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	0
	合计	0

8.4 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	10,002,444.69	6.66%	10,000,000.00	6.65%	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	10,002,444.69	6.66%	10,000,000.00	6.65%	不少于三年

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
基金合同生效日(2019年7月16日)基金份额总额	44,993,831.21	79,390,496.42
本报告期期初基金份额总额	27,663,098.16	55,587,898.99
本报告期基金总申购份额	45,271,960.40	74,139,996.57
减：本报告期基金总赎回份额	9,650,781.58	42,741,833.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	63,284,276.98	86,986,062.23

§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，本基金无基金份额持有人大会决议。

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 2021 年 4 月 9 日发布公告，郑煜女士、孙彬先生担任华夏基金管理有限公司副总经理，蔡向阳先生担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

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	
中信证券	11	113,979,590.92	89.63%	50,845.04	90.17%	-
方正证券	2	7,559,114.30	5.94%	3,383.47	6.00%	-
广发证券	2	4,258,676.23	3.35%	1,952.79	3.46%	-
国泰君安证券	2	1,368,649.09	1.08%	205.33	0.36%	-

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、长江证券、东方证券、高华证券、国泰君安、华泰证券、西部证券、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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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
中信证券	275,764.58	72.20%	-	-
方正证券	106,197.70	27.80%	-	-
广发证券	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-

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旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-09
2	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金在 2021 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-13
3	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
4	华夏基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
5	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-27
6	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-01

7	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-24
8	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
9	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修订旗下部分公募基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
10	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
11	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-07
12	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
13	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
14	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
15	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-08
16	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
17	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-13
18	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-19
19	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-25
20	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
21	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
22	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-09
23	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-17

§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

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。

§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 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数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。

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

二〇二一年八月三十日