

**华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数
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.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§8 基金份额持有人信息.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§12 备查文件目录.....	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCIA 股（扩位证券简称：MSCIA 股 ETF）
基金主代码	512990
交易代码	512990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 17 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
报告期末基金份额总额	383,015,418.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所

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，以期获得与标的指数收益相似的回报。
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、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66594319
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1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1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
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）
本期已实现收益	80,859,665.60
本期利润	52,193,860.89
加权平均基金份额本期利润	0.1246
本期加权平均净值利润率	6.89%
本期基金份额净值增长率	6.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	339,045,161.99
期末可供分配基金份额利润	0.8852
期末基金资产净值	722,060,579.99
期末基金份额净值	1.8852
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	98.25%

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

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	0.93%	0.84%	-0.55%	0.84%	1.48%	0.00%

过去三个月	9.56%	0.97%	6.84%	0.98%	2.72%	-0.01%
过去六个月	6.53%	1.32%	3.38%	1.32%	3.15%	0.00%
过去一年	37.25%	1.33%	28.40%	1.33%	8.85%	0.00%
自基金转型起至今	98.25%	1.35%	73.24%	1.36%	25.01%	-0.01%

3.2.2 自基金转型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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
 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

(2018 年 9 月 17 日至 2021 年 6 月 30 日)



§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	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
荣膺	本基金的基金经理、投委会成员	2018-09-17	-	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 MSCI 中国 A 股国际通指数，MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index) 由 MSCI 公司于 2017 年 10 月 23 日发布，其成份股为 A 股纳入 MSCI 新兴市场指数 (MSCI Emerging Markets Index) 的部分，该指数能够完整反映 A 股逐步纳入 MSCI 新兴市场指数的进程。截至 2021 年 6 月 30 日，MSCI 中国 A 股国际通指数成份股 481 只。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。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，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、赎回及成份股调整等工作。

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广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中国国际金融有限公司等。

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 1.8852 元，本报告期份额净值增长率为 6.53%，同期业绩比较基准增长率 3.38%。本基金本报告期跟踪偏离度为+3.15%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

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。

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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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	7,244,128.74	10,627,312.17
结算备付金		10,309,157.02	10,167,200.04
存出保证金		2,132,850.73	2,764,663.94
交易性金融资产	6.4.7.2	703,814,314.91	818,003,327.97
其中：股票投资		703,755,014.91	817,416,327.97
基金投资		-	-
债券投资		59,300.00	587,000.00

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		264,354.85	-
应收利息	6.4.7.5	6,633.47	8,591.90
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		723,771,439.72	841,571,096.02
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		14,851.39	543,230.63
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		297,395.80	305,871.48
应付托管费		59,479.18	61,174.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	226,141.67	304,271.77
应交税费		525.65	91.87
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,112,466.04	606,110.33
负债合计		1,710,859.73	1,820,750.32
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	383,015,418.00	474,515,418.00
未分配利润	6.4.7.10	339,045,161.99	365,234,927.70
所有者权益合计		722,060,579.99	839,750,345.70
负债和所有者权益总计		723,771,439.72	841,571,096.02

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8852 元，基金份额总额 383,015,418.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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 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
一、收入		55,246,857.10	52,866,990.24
1.利息收入		146,653.82	100,925.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	117,073.93	68,319.43
债券利息收入		154.99	112.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,931.51	516.44
证券出借利息收入		27,493.39	31,976.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		83,866,725.64	44,097,986.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	77,755,967.10	38,999,772.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	134,748.04	206,817.85
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	1,309,572.81	316,291.26
股利收益	6.4.7.17	4,666,437.69	4,575,105.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-28,665,804.71	9,188,619.73
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	-100,717.65	-520,541.19
减：二、费用		3,052,996.21	2,340,682.86
1.管理人报酬		1,890,791.04	1,292,561.40
2.托管费		378,158.25	258,512.23
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	548,371.18	598,404.39
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		4,011.46	1,045.13
7.其他费用	6.4.7.21	231,664.28	190,159.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		52,193,860.89	50,526,307.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		52,193,860.89	50,526,307.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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）	474,515,418.00	365,234,927.70	839,750,345.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,193,860.89	52,193,860.89
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）	-91,500,000.00	-78,383,626.60	-169,883,626.60
其中：1.基金申购款	108,000,000.00	90,345,403.82	198,345,403.82
2.基金赎回款	-199,500,000.00	-168,729,030.42	-368,229,030.42
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）	383,015,418.00	339,045,161.99	722,060,579.99
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）	442,621,733.00	113,544,672.18	556,166,405.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	50,526,307.38	50,526,307.38
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）	123,893,685.00	47,598,936.80	171,492,621.80
其中：1.基金申购款	480,000,000.00	136,657,333.34	616,657,333.34
2.基金赎回款	-356,106,315.00	-89,058,396.54	-445,164,711.54
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）	566,515,418.00	211,669,916.36	778,185,334.36

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

原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（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[2014]870 号《关于准予 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》，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》、《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数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。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 1 月 19 日至 2015 年 2 月 6 日期间共募集 4,136,470,618.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0145 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,136,570,680 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,062 份基金份额。

根据原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金变更标的指数并修订基金合同有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金自 2018 年 9 月 17 日正式变更为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金；MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金自 2018 年 9 月 17 日正式变更为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并继续以变更后的华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金作为目标 ETF。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《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、货币市场工具、国债期货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（但须符合中国证监会相关规定）。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	7,244,128.74
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	7,244,128.74

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	613,349,463.78	703,755,014.91	90,405,551.13
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	59,300.00	59,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	59,300.00	59,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	613,408,763.78	703,814,314.91	90,405,551.13

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	16,319,480.00	-	-	-
其中：股指期货	16,319,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	16,319,480.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量 (买/卖) (单位： 手)	合约市值	公允价值变动	风险说明

IF2109	沪深 300 股指期货 IF2109 合约	9	13,949,280.00	232,200.00	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。
IC2107	中证 500 股指期货 IC2107 合约	2	2,706,880.00	104,480.00	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					336,680.00
股指期货投资本期收益					1,309,572.81
股指期货投资本期公允价值变动					-760,700.00

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	690.62
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	5,558.26
应收债券利息	4.84
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	343.75
其他	36.00
合计	6,633.47

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	226,141.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	226,141.67

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,219.55
应付指数使用费	548,465.69
应退替代款	469,780.80
合计	1,112,466.04

6.4.7.9 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	474,515,418.00	474,515,418.00
本期申购	108,000,000.00	108,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-199,500,000.00	-199,500,000.00
本期末	383,015,418.00	383,015,418.00

6.4.7.10 未分配利润

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	431,221,086.51	-65,986,158.81	365,234,927.70
本期利润	80,859,665.60	-28,665,804.71	52,193,860.89
本期基金份额交易产生的变动数	-91,734,026.26	13,350,399.66	-78,383,626.60
其中：基金申购款	105,824,265.89	-15,478,862.07	90,345,403.82
基金赎回款	-197,558,292.15	28,829,261.73	-168,729,030.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	420,346,725.85	-81,301,563.86	339,045,161.99

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	14,283.54

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	101,878.87
其他	911.52
合计	117,073.93

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	47,619,518.66
股票投资收益——赎回差价收入	30,136,448.44
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	77,755,967.10

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	272,361,161.14
减：卖出股票成本总额	224,741,642.48
买卖股票差价收入	47,619,518.66

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	368,229,030.42
减：现金支付赎回款总额	152,438,104.42
减：赎回股票成本总额	185,654,477.56
赎回差价收入	30,136,448.44

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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	1,615,244.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,480,300.00
减：应收利息总额	196.45
买卖债券差价收入	134,748.04

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	1,309,572.81
合计	1,309,572.81

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	4,666,437.69
其中：证券出借权益补偿收入	27,850.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,666,437.69

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	-27,905,104.71
——股票投资	-27,905,104.71
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-760,700.00
——权证投资	-
——期货投资	-760,700.00
4.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	-28,665,804.71

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	-
替代损益	-100,717.65
合计	-100,717.65

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	548,371.18
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	548,371.18

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5,089.37
指数使用费	132,355.36
合计	231,664.28

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

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	361,743,086.67	76.44%	17,314,662.35	2.92%

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	1,531,072.29	94.79%	103,934.14	8.86%

6.4.10.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	2,500,000.00	100.00%	-	-

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	156,023.84	76.44%	63,940.44	28.27%
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	7,468.44	2.92%	4,070.19	1.34%

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	1,890,791.04	1,292,561.40
其中：支付销售机构的客户维护费	14,311.70	16,351.13

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	378,158.25	258,512.23

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。

6.4.10.3 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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	3,941,300.00	2,628.83	-	-
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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	2,989,577.00	2,195.43	315,018.00	360.78

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

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	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期 限(单 位:天)	费率	利息 收入	期末 证券 出借 业务 余额	期末应 收利息 余额
中信证券	2021012100000471	红日药业	2021-01-21	44,100.00	10,000.00	14	3.60	61.74	-	-
中信证券	2021020400013575	红日药业	2021-02-04	38,100.00	10,000.00	14	3.60	53.34	-	-
中信证券	2021021800043086	红日药业	2021-02-18	40,400.00	10,000.00	14	3.50	54.99	-	-
中信证券	2021030400034847	红日药业	2021-03-04	41,900.00	10,000.00	14	3.30	53.77	-	-
中信证券	2021031800037540	红日药业	2021-03-18	40,900.00	10,000.00	14	3.40	54.08	-	-
中信证券	2021040100030469	红日药业	2021-04-01	40,900.00	10,000.00	14	3.50	55.67	-	-
中信证券	2021041500032470	红日药业	2021-04-15	39,300.00	10,000.00	14	3.50	53.49	-	-
中信证券	2021042900023947	红日药业	2021-04-29	40,900.00	10,000.00	14	3.50	55.67	-	-
中	2021051300027626	红	2021-05-13	45,800.00	10,000.00	14	3.50	62.34	-	-

信 证 券		日 药 业								
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	合 约 编 号	证 券 名 称	成 交 时 间	交 易 金 额	交 易 数 量 (单 位: 股)	出 借 期 限 (单 位: 天)	费 率	利 息 收 入	期 末 证 券 出 借 业 务 余 额	期 末 应 收 利 息 余 额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

无。

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

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
华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	130,908,181.00	34.18%	204,575,781.00	43.11%

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
中国银行活期存款	7,244,128.74	14,283.54	20,686,482.1	30,722.98

			3	
--	--	--	---	--

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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	688819	天能股份	网下申购	13,552	566,338.08
中信证券	688660	电气风电	网下申购	44,065	239,713.60
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10
中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
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
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

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 130,769,080.00 元（上年度可比期间：

92,284,440.00 元)，支付给中信期货的佣金为 3,203.85 元（上年度可比期间为：2,302.01 元）。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 4,161,987.20 元，占基金资产净值的比例为 0.58%（2020 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 6,226,332.00 元，占基金资产净值的比例为 0.74%）。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中国银行而被动）持有的中国银行股票估值总额为人民币 1,695,848.00 元，占基金资产净值的比例为 0.23%（2020 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中国银行而被动）持有的中国银行股票估值总额为人民币 2,220,912.00 元，占基金资产净值的比例为 0.26%）。

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	-
688696	极米科技	2021-02-23	2021-09-03	新发流通受限	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-07-07	新发流通	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	-

				受限						
688819	天能股份	2021-01-07	2021-07-19	新发流通受限	41.79	43.69	13,552	566,338.08	592,086.88	-
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	新发流通受限	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
688613	奥精医疗	2021-05-13	2021-11-22	新发流通受限	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新发流通受限	47.33	251.96	554	26,220.82	139,585.84	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新发流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新发流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-12-31	新发流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

688633	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	新发 流通 受限	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新发 流通 受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688314	康拓医疗	2021-05-11	2021-11-18	新发 流通 受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新发 流通 受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新发 流通 受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新发 流通 受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新发 流通 受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高	2021-04-08	2021-10-15	新发	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-

	食品			流通受限						
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新发流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新发流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新发流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新发流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新发流通	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-

				受限						
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新发流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新发流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新发流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新发流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新发流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新发流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新发流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新发流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新发流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新发流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉	2021-03-03	2021-09-13	新发	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-

	安 防			流 通 受 限						
301016	雷 尔 伟	2021-06-23	2021-12-30	新 发 流 通 受 限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共 同 药 业	2021-03-31	2021-10-11	新 发 流 通 受 限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼 卡 龙	2021-02-03	2021-08-10	新 发 流 通 受 限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠 中 生 态	2021-02-18	2021-08-25	新 发 流 通 受 限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通 用 电 梯	2021-01-13	2021-07-21	新 发 流 通 受 限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深 水 海 纳	2021-03-23	2021-09-30	新 发 流 通 受 限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德 固 特	2021-02-24	2021-09-03	新 发 流 通	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-

				受限						
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新发流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新发流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新发流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新发流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新发流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新发流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-

300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新发 流通 受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新发 流通 受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新发 流通 受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新发 流通 受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新发 流通 受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新发 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新发 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立	2021-06-09	2021-12-17	新发	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

	科技			流通受限						
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新发流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新发流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新发流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新发流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新发流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新发流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新发流通	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-

				受限						
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新发流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新发流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新发流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

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
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新发流通受限	100.00	100.00	237	23,700.00	23,700.00	-
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	新发流通受限	100.00	100.00	200	20,000.00	20,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	新发流通受限	100.00	100.00	156	15,600.00	15,600.00	-

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，锁定期限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
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项	5.59	2021-07-06	6.15	147,000	1,288,405.58	821,730.00	-
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项	56.35	2021-07-01	59.49	20,600	415,008.76	1,160,810.00	-

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（单 位：股）	期末估值总额
1	601216	君正集团	2021年7月1日 -2021年7月1日	5.09	36,000.00	183,240.00
2	600010	包钢股份	2021年7月1日 -2021年7月1日	1.55	100,000.00	155,000.00
合计	-	-	-	-	136,000.00	338,240.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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之内。

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

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。

6.4.13.4.2 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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	上年度末
----	-----	------

	2021 年 6 月 30 日		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	703,755,014.91	97.46	817,416,327.97	97.34
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	59,300.00	0.01	587,000.00	0.07
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	703,814,314.91	97.47	818,003,327.97	97.41

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 MSCI 中国 A 股国际通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%	-35,937,475.15	-40,900,522.19
	+5%	35,937,475.15	40,900,522.19

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 694,897,810.88 元，第二层次的余额为 8,916,504.03 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 814,050,875.59 元，第二层次的余额为 3,952,452.38 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	703,755,014.91	97.23
	其中：股票	703,755,014.91	97.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,300.00	0.01
	其中：债券	59,300.00	0.01
	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	17,553,285.76	2.43
8	其他各项资产	2,403,839.05	0.33
9	合计	723,771,439.72	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 338,240.00 元，占本基金期末资产净值的 0.05%。

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	7,681,275.60	1.06
B	采矿业	17,494,838.19	2.42
C	制造业	415,098,665.84	57.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,810,690.22	2.47
E	建筑业	8,382,665.48	1.16
F	批发和零售业	9,177,900.14	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	20,140,741.45	2.79
H	住宿和餐饮业	814,385.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,537,959.40	2.84
J	金融业	133,536,431.02	18.49
K	房地产业	14,759,559.20	2.04
L	租赁和商务服务业	12,547,468.00	1.74
M	科学研究和技术服务业	9,962,900.52	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	826,441.33	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	739,506.00	0.10
Q	卫生和社会工作	10,886,652.80	1.51
R	文化、体育和娱乐业	3,356,934.72	0.46
S	综合	-	-
	合计	703,755,014.91	97.46

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	600519	贵州茅台	19,722	40,562,237.40	5.62
2	300750	宁德时代	36,500	19,520,200.00	2.70
3	000858	五粮液	60,829	18,120,350.81	2.51
4	600036	招商银行	323,352	17,522,444.88	2.43
5	601318	中国平安	169,740	10,910,887.20	1.51
6	601888	中国中免	30,536	9,163,853.60	1.27
7	300760	迈瑞医疗	19,000	9,120,950.00	1.26
8	601012	隆基股份	82,796	7,355,596.64	1.02
9	600900	长江电力	356,346	7,354,981.44	1.02
10	002594	比亚迪	28,490	7,150,990.00	0.99
11	603288	海天味业	54,964	7,087,607.80	0.98
12	000001	平安银行	304,188	6,880,732.56	0.95
13	600276	恒瑞医药	100,295	6,817,051.15	0.94

14	601166	兴业银行	325,516	6,689,353.80	0.93
15	603259	药明康德	40,128	6,283,643.52	0.87
16	600809	山西汾酒	13,653	6,116,544.00	0.85
17	300015	爱尔眼科	83,784	5,946,988.32	0.82
18	000568	泸州老窖	22,961	5,417,418.34	0.75
19	600309	万华化学	49,200	5,353,944.00	0.74
20	300059	东方财富	161,912	5,309,094.48	0.74
21	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.71
22	601398	工商银行	985,900	5,097,103.00	0.71
23	002475	立讯精密	109,583	5,040,818.00	0.70
24	002714	牧原股份	82,560	5,021,299.20	0.70
25	002304	洋河股份	23,633	4,896,757.60	0.68
26	002352	顺丰控股	71,400	4,833,780.00	0.67
27	300122	智飞生物	25,100	4,686,923.00	0.65
28	601919	中远海控	151,700	4,632,918.00	0.64
29	600000	浦发银行	460,048	4,600,480.00	0.64
30	603501	韦尔股份	13,600	4,379,200.00	0.61
31	600436	片仔癀	9,391	4,209,985.30	0.58
32	600030	中信证券	166,880	4,161,987.20	0.58
33	000333	美的集团	55,200	3,939,624.00	0.55
34	600031	三一重工	132,959	3,865,118.13	0.54
35	002142	宁波银行	94,190	3,670,584.30	0.51
36	000002	万科 A	152,389	3,628,382.09	0.50
37	601288	农业银行	1,167,500	3,537,525.00	0.49
38	600887	伊利股份	95,316	3,510,488.28	0.49
39	601816	京沪高铁	641,500	3,393,535.00	0.47
40	000725	京东方 A	530,650	3,311,256.00	0.46
41	002812	恩捷股份	13,900	3,253,990.00	0.45
42	601601	中国太保	107,242	3,106,800.74	0.43
43	300014	亿纬锂能	29,573	3,073,521.89	0.43
44	601668	中国建筑	657,727	3,058,430.55	0.42
45	600438	通威股份	70,500	3,050,535.00	0.42
46	601328	交通银行	615,246	3,014,705.40	0.42
47	300124	汇川技术	40,400	3,000,104.00	0.42
48	601899	紫金矿业	309,400	2,998,086.00	0.42
49	300782	卓胜微	5,280	2,838,000.00	0.39
50	002493	荣盛石化	158,725	2,741,180.75	0.38
51	600104	上汽集团	122,162	2,683,899.14	0.37
52	600019	宝钢股份	349,106	2,667,169.84	0.37
53	300274	阳光电源	22,900	2,634,874.00	0.36
54	600585	海螺水泥	62,770	2,576,708.50	0.36
55	600690	海尔智家	98,868	2,561,669.88	0.35
56	000661	长春高新	6,400	2,476,800.00	0.34

57	600016	民生银行	555,824	2,451,183.84	0.34
58	601818	光大银行	648,100	2,449,818.00	0.34
59	600346	恒力石化	91,840	2,409,881.60	0.33
60	002230	科大讯飞	34,811	2,352,527.38	0.33
61	000538	云南白药	19,977	2,311,738.44	0.32
62	300433	蓝思科技	78,000	2,293,980.00	0.32
63	002241	歌尔股份	53,520	2,287,444.80	0.32
64	600196	复星医药	31,421	2,266,396.73	0.31
65	600048	保利地产	187,560	2,258,222.40	0.31
66	600703	三安光电	70,200	2,249,910.00	0.31
67	300759	康龙化成	10,300	2,234,997.00	0.31
68	600893	航发动力	41,772	2,221,852.68	0.31
69	600999	招商证券	116,297	2,211,968.94	0.31
70	600028	中国石化	499,300	2,176,948.00	0.30
71	603799	华友钴业	19,018	2,171,855.60	0.30
72	002027	分众传媒	230,040	2,164,676.40	0.30
73	002371	北方华创	7,700	2,135,826.00	0.30
74	601066	中信建投	67,800	2,130,954.00	0.30
75	002311	海大集团	26,100	2,129,760.00	0.29
76	002460	赣锋锂业	17,457	2,113,868.13	0.29
77	600763	通策医疗	5,100	2,096,100.00	0.29
78	601658	邮储银行	416,800	2,092,336.00	0.29
79	600406	国电南瑞	87,009	2,022,089.16	0.28
80	601088	中国神华	103,452	2,019,383.04	0.28
81	601211	国泰君安	117,800	2,019,092.00	0.28
82	000063	中兴通讯	60,500	2,010,415.00	0.28
83	603986	兆易创新	10,400	1,954,160.00	0.27
84	300413	芒果超媒	28,030	1,922,858.00	0.27
85	000338	潍柴动力	106,300	1,899,581.00	0.26
86	600745	闻泰科技	19,500	1,889,550.00	0.26
87	601225	陕西煤业	156,769	1,857,712.65	0.26
88	000625	长安汽车	69,852	1,835,710.56	0.25
89	002129	中环股份	47,500	1,833,500.00	0.25
90	601229	上海银行	222,661	1,825,820.20	0.25
91	601688	华泰证券	115,300	1,821,740.00	0.25
92	601857	中国石油	338,400	1,790,136.00	0.25
93	601100	恒立液压	20,420	1,754,486.40	0.24
94	600660	福耀玻璃	31,300	1,748,105.00	0.24
95	600837	海通证券	151,336	1,740,364.00	0.24
96	300454	深信服	6,600	1,712,568.00	0.24
97	600588	用友网络	51,175	1,702,080.50	0.24
98	601988	中国银行	550,600	1,695,848.00	0.23
99	000100	TCL 科技	219,800	1,681,470.00	0.23

100	300999	金龙鱼	19,780	1,680,508.80	0.23
101	601390	中国中铁	319,170	1,672,450.80	0.23
102	603486	科沃斯	7,300	1,664,984.00	0.23
103	000166	申万宏源	353,241	1,653,167.88	0.23
104	601009	南京银行	156,850	1,650,062.00	0.23
105	600919	江苏银行	231,471	1,643,444.10	0.23
106	601169	北京银行	331,362	1,613,732.94	0.22
107	300601	康泰生物	10,700	1,594,300.00	0.22
108	002709	天赐材料	14,510	1,546,475.80	0.21
109	600760	中航沈飞	25,620	1,544,886.00	0.21
110	603806	福斯特	14,480	1,522,282.40	0.21
111	601633	长城汽车	34,900	1,521,291.00	0.21
112	600570	恒生电子	16,301	1,520,068.25	0.21
113	601336	新华保险	32,600	1,496,666.00	0.21
114	300142	沃森生物	24,217	1,494,188.90	0.21
115	600132	重庆啤酒	7,500	1,484,625.00	0.21
116	603659	璞泰来	10,840	1,480,744.00	0.21
117	601628	中国人寿	43,560	1,476,248.40	0.20
118	601155	新城控股	35,463	1,475,260.80	0.20
119	601989	中国重工	357,500	1,472,900.00	0.20
120	000596	古井贡酒	6,100	1,460,950.00	0.20
121	002821	凯莱英	3,900	1,453,140.00	0.20
122	002049	紫光国微	9,400	1,449,386.00	0.20
123	000895	双汇发展	45,250	1,438,950.00	0.20
124	300498	温氏股份	99,876	1,435,218.12	0.20
125	603993	洛阳钼业	276,900	1,428,804.00	0.20
126	601138	工业富联	114,200	1,417,222.00	0.20
127	000776	广发证券	92,800	1,404,992.00	0.19
128	300595	欧普康视	13,295	1,376,697.25	0.19
129	600926	杭州银行	92,920	1,370,570.00	0.19
130	002179	中航光电	17,280	1,365,465.60	0.19
131	001979	招商蛇口	124,161	1,359,562.95	0.19
132	002050	三花智控	56,295	1,349,954.10	0.19
133	000799	酒鬼酒	5,200	1,329,120.00	0.18
134	600989	宝丰能源	95,800	1,310,544.00	0.18
135	600741	华域汽车	49,383	1,297,291.41	0.18
136	002841	视源股份	10,400	1,292,616.00	0.18
137	600600	青岛啤酒	11,086	1,282,095.90	0.18
138	000963	华东医药	27,489	1,264,768.89	0.18
139	600015	华夏银行	201,048	1,244,487.12	0.17
140	603899	晨光文具	14,500	1,226,120.00	0.17
141	002601	龙麟佰利	35,100	1,213,758.00	0.17
142	300408	三环集团	28,520	1,209,818.40	0.17

143	601901	方正证券	128,800	1,205,568.00	0.17
144	688185	康希诺	1,538	1,196,210.26	0.17
145	300628	亿联网络	14,150	1,185,770.00	0.16
146	600111	北方稀土	56,927	1,178,388.90	0.16
147	600460	士兰微	20,600	1,160,810.00	0.16
148	002001	新和成	40,460	1,160,392.80	0.16
149	600150	中国船舶	70,100	1,157,351.00	0.16
150	601985	中国核电	228,000	1,153,680.00	0.16
151	300347	泰格医药	5,950	1,150,135.00	0.16
152	000768	中航西飞	43,460	1,142,128.80	0.16
153	603882	金域医学	7,100	1,134,367.00	0.16
154	601877	正泰电器	33,620	1,122,235.60	0.16
155	002568	百润股份	11,711	1,110,085.69	0.15
156	600010	包钢股份	714,406	1,107,329.30	0.15
157	603833	欧派家居	7,760	1,101,609.60	0.15
158	601788	光大证券	61,300	1,096,657.00	0.15
159	600547	山东黄金	56,663	1,089,062.86	0.15
160	601600	中国铝业	205,100	1,087,030.00	0.15
161	002736	国信证券	100,495	1,080,321.25	0.15
162	300529	健帆生物	12,450	1,075,182.00	0.15
163	603369	今世缘	19,700	1,066,952.00	0.15
164	002648	卫星石化	27,040	1,059,697.60	0.15
165	603737	三棵树	6,020	1,059,520.00	0.15
166	000301	东方盛虹	50,500	1,055,450.00	0.15
167	600584	长电科技	28,000	1,055,040.00	0.15
168	300496	中科创达	6,697	1,051,830.82	0.15
169	600886	国投电力	109,176	1,049,181.36	0.15
170	002007	华兰生物	28,590	1,048,681.20	0.15
171	601916	浙商银行	262,000	1,040,140.00	0.14
172	000786	北新建材	26,500	1,040,125.00	0.14
173	000876	新希望	70,600	1,035,702.00	0.14
174	002064	华峰化学	72,600	1,030,920.00	0.14
175	000157	中联重科	110,800	1,023,792.00	0.14
176	600426	华鲁恒升	33,064	1,023,330.80	0.14
177	300316	晶盛机电	20,138	1,016,969.00	0.14
178	002600	领益智造	110,600	1,016,414.00	0.14
179	601377	兴业证券	105,000	1,014,300.00	0.14
180	002414	高德红外	36,728	1,012,958.24	0.14
181	601939	建设银行	150,347	999,807.55	0.14
182	002236	大华股份	47,150	994,865.00	0.14
183	601799	星宇股份	4,400	993,168.00	0.14
184	002791	坚朗五金	5,100	989,655.00	0.14
185	000938	紫光股份	44,895	982,302.60	0.14

186	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.14
187	600176	中国巨石	62,823	974,384.73	0.13
188	603345	安井食品	3,800	965,276.00	0.13
189	600029	南方航空	160,100	963,802.00	0.13
190	600779	水井坊	7,600	960,260.00	0.13
191	000069	华侨城 A	128,550	956,412.00	0.13
192	300661	圣邦股份	3,775	954,055.75	0.13
193	601966	玲珑轮胎	21,515	941,066.10	0.13
194	300033	同花顺	8,300	936,074.00	0.13
195	600958	东方证券	93,500	934,065.00	0.13
196	601669	中国电建	239,700	927,639.00	0.13
197	603160	汇顶科技	7,100	920,373.00	0.13
198	601360	三六零	74,680	911,842.80	0.13
199	300003	乐普医疗	28,000	899,360.00	0.12
200	600115	中国东航	175,476	891,418.08	0.12
201	600845	宝信软件	17,480	889,732.00	0.12
202	300146	汤臣倍健	26,700	878,430.00	0.12
203	002074	国轩高科	20,100	875,556.00	0.12
204	002938	鹏鼎控股	24,200	868,296.00	0.12
205	601233	桐昆股份	35,800	862,422.00	0.12
206	600061	国投资本	100,692	854,875.08	0.12
207	601995	中金公司	13,751	845,686.50	0.12
208	600143	金发科技	40,400	842,744.00	0.12
209	002916	深南电路	7,580	842,365.40	0.12
210	600183	生益科技	35,900	840,419.00	0.12
211	601618	中国中冶	279,742	833,631.16	0.12
212	002024	苏宁易购	147,000	821,730.00	0.11
213	002459	晶澳科技	16,700	818,300.00	0.11
214	601021	春秋航空	14,356	816,856.40	0.11
215	600754	锦江酒店	14,300	814,385.00	0.11
216	601111	中国国航	104,000	809,120.00	0.11
217	300207	欣旺达	24,700	804,232.00	0.11
218	603517	绝味食品	9,500	800,755.00	0.11
219	601878	浙商证券	60,800	795,264.00	0.11
220	002555	三七互娱	33,100	795,062.00	0.11
221	002252	上海莱士	105,600	790,944.00	0.11
222	603185	上机数控	4,400	787,380.00	0.11
223	300676	华大基因	6,600	782,760.00	0.11
224	000425	徐工机械	122,700	781,599.00	0.11
225	002920	德赛西威	7,100	781,568.00	0.11
226	601636	旗滨集团	42,100	781,376.00	0.11
227	300285	国瓷材料	15,700	765,375.00	0.11
228	603816	顾家家居	9,800	757,344.00	0.10

229	002602	世纪华通	116,780	749,727.60	0.10
230	600089	特变电工	58,210	747,998.50	0.10
231	600332	白云山	22,037	745,952.45	0.10
232	688008	澜起科技	11,915	743,257.70	0.10
233	002607	中公教育	35,400	739,506.00	0.10
234	600161	天坛生物	21,560	738,430.00	0.10
235	300223	北京君正	7,300	736,716.00	0.10
236	600009	上海机场	15,149	729,121.37	0.10
237	300751	迈为股份	1,600	727,520.00	0.10
238	600885	宏发股份	11,600	727,320.00	0.10
239	601881	中国银河	67,400	726,572.00	0.10
240	600362	江西铜业	32,464	726,544.32	0.10
241	600079	人福医药	25,700	726,539.00	0.10
242	002624	完美世界	30,300	724,473.00	0.10
243	600383	金地集团	70,674	723,701.76	0.10
244	601838	成都银行	56,600	715,424.00	0.10
245	300558	贝达药业	6,600	714,384.00	0.10
246	688002	睿创微纳	7,153	714,083.99	0.10
247	600674	川投能源	57,464	708,531.12	0.10
248	601727	上海电气	166,900	707,656.00	0.10
249	601933	永辉超市	149,100	705,243.00	0.10
250	600298	安琪酵母	12,900	701,502.00	0.10
251	002625	光启技术	33,700	701,297.00	0.10
252	002340	格林美	75,000	701,250.00	0.10
253	601865	福莱特	17,700	699,681.00	0.10
254	600352	浙江龙盛	50,900	699,366.00	0.10
255	300677	英科医疗	5,600	698,880.00	0.10
256	300450	先导智能	11,580	696,421.20	0.10
257	600606	绿地控股	127,100	692,695.00	0.10
258	600018	上港集团	145,200	692,604.00	0.10
259	603658	安图生物	9,140	692,537.80	0.10
260	000703	恒逸石化	57,750	690,112.50	0.10
261	002080	中材科技	26,330	689,056.10	0.10
262	300144	宋城演艺	40,960	688,128.00	0.10
263	002508	老板电器	14,798	688,107.00	0.10
264	601117	中国化学	77,300	677,148.00	0.09
265	600219	南山铝业	187,300	674,280.00	0.09
266	601216	君正集团	132,200	672,898.00	0.09
267	600862	中航高科	21,800	671,004.00	0.09
268	002353	杰瑞股份	15,000	670,500.00	0.09
269	000066	中国长城	45,900	670,140.00	0.09
270	000825	太钢不锈	89,200	668,108.00	0.09
271	002185	华天科技	43,000	661,770.00	0.09

272	603127	昭衍新药	3,600	661,500.00	0.09
273	601162	天风证券	135,800	659,988.00	0.09
274	002202	金风科技	54,084	657,661.44	0.09
275	600489	中金黄金	75,948	654,671.76	0.09
276	300037	新宙邦	6,500	650,650.00	0.09
277	601689	拓普集团	17,300	647,539.00	0.09
278	000977	浪潮信息	22,840	642,489.20	0.09
279	688009	中国通号	112,641	640,927.29	0.09
280	603605	珀莱雅	3,245	638,323.95	0.09
281	300724	捷佳伟创	5,500	638,055.00	0.09
282	600315	上海家化	10,600	637,484.00	0.09
283	601607	上海医药	30,066	635,294.58	0.09
284	000932	华菱钢铁	96,100	634,260.00	0.09
285	000783	长江证券	86,634	634,160.88	0.09
286	603233	大参林	12,380	632,741.80	0.09
287	603456	九洲药业	13,000	631,540.00	0.09
288	603589	口子窖	9,300	629,517.00	0.09
289	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.09
290	600704	物产中大	79,200	623,304.00	0.09
291	002120	韵达股份	45,440	614,803.20	0.09
292	002013	中航机电	60,900	613,263.00	0.08
293	002444	巨星科技	17,900	610,032.00	0.08
294	601990	南京证券	57,800	608,056.00	0.08
295	300699	光威复材	8,000	607,600.00	0.08
296	600109	国金证券	47,500	602,775.00	0.08
297	603939	益丰药房	10,738	602,294.42	0.08
298	002223	鱼跃医疗	15,700	598,641.00	0.08
299	601696	中银证券	29,000	597,110.00	0.08
300	600188	兖州煤业	38,800	595,968.00	0.08
301	688819	天能股份	13,552	592,086.88	0.08
302	601108	财通证券	56,200	589,538.00	0.08
303	600655	豫园股份	50,629	586,790.11	0.08
304	601872	招商轮船	126,920	586,370.40	0.08
305	002690	美亚光电	10,500	585,480.00	0.08
306	002409	雅克科技	7,200	583,200.00	0.08
307	000807	云铝股份	49,000	583,100.00	0.08
308	603444	吉比特	1,100	583,000.00	0.08
309	002157	正邦科技	48,600	580,770.00	0.08
310	002673	西部证券	70,032	577,764.00	0.08
311	000027	深圳能源	62,170	570,098.90	0.08
312	002294	信立泰	17,265	568,018.50	0.08
313	002511	中顺洁柔	20,600	567,530.00	0.08
314	603638	艾迪精密	13,080	560,739.60	0.08

315	002384	东山精密	26,900	560,596.00	0.08
316	002044	美年健康	61,368	559,062.48	0.08
317	000830	鲁西化工	29,800	558,154.00	0.08
318	601699	潞安环能	47,060	555,778.60	0.08
319	601077	渝农商行	138,600	553,014.00	0.08
320	002603	以岭药业	18,900	551,124.00	0.08
321	002078	太阳纸业	41,200	550,020.00	0.08
322	603613	国联股份	5,500	549,835.00	0.08
323	601319	中国人保	92,700	549,711.00	0.08
324	600699	均胜电子	21,479	548,144.08	0.08
325	688006	杭可科技	6,446	547,910.00	0.08
326	600486	扬农化工	4,900	547,673.00	0.08
327	000050	深天马 A	38,500	545,930.00	0.08
328	000728	国元证券	68,360	544,829.20	0.08
329	000739	普洛药业	18,500	543,900.00	0.08
330	300253	卫宁健康	33,410	543,580.70	0.08
331	002032	苏泊尔	8,500	542,215.00	0.08
332	002180	纳思达	16,800	540,960.00	0.07
333	600705	中航资本	139,736	540,778.32	0.07
334	000983	山西焦煤	64,168	533,236.08	0.07
335	000800	一汽解放	48,900	529,098.00	0.07
336	002405	四维图新	35,700	524,790.00	0.07
337	002430	杭氧股份	15,100	522,309.00	0.07
338	002507	涪陵榨菜	13,838	521,139.08	0.07
339	600872	中炬高新	12,400	521,048.00	0.07
340	300357	我武生物	8,113	520,205.56	0.07
341	002372	伟星新材	25,000	516,750.00	0.07
342	000723	美锦能源	67,200	508,032.00	0.07
343	600827	百联股份	25,200	507,780.00	0.07
344	603707	健友股份	12,160	507,680.00	0.07
345	600369	西南证券	104,200	507,454.00	0.07
346	601555	东吴证券	60,819	507,230.46	0.07
347	002156	通富微电	20,800	500,032.00	0.07
348	600372	中航电子	30,200	499,810.00	0.07
349	600739	辽宁成大	23,966	498,732.46	0.07
350	300251	光线传媒	46,000	497,260.00	0.07
351	600233	圆通速递	49,500	495,495.00	0.07
352	601615	明阳智能	30,500	493,795.00	0.07
353	002152	广电运通	37,800	492,534.00	0.07
354	600803	新奥股份	29,700	490,347.00	0.07
355	000860	顺鑫农业	11,600	489,288.00	0.07
356	002138	顺络电子	12,600	488,502.00	0.07
357	600038	中直股份	9,200	485,208.00	0.07

358	600011	华能国际	114,900	484,878.00	0.07
359	000656	金科股份	83,600	484,044.00	0.07
360	000513	丽珠集团	9,600	480,192.00	0.07
361	600522	中天科技	48,000	480,000.00	0.07
362	600392	盛和资源	27,600	479,136.00	0.07
363	601058	赛轮轮胎	47,900	478,521.00	0.07
364	600875	东方电气	43,600	478,292.00	0.07
365	600177	雅戈尔	72,500	477,775.00	0.07
366	600521	华海药业	22,860	477,316.80	0.07
367	000547	航天发展	25,200	475,524.00	0.07
368	603267	鸿远电子	3,700	473,304.00	0.07
369	601198	东兴证券	43,300	473,269.00	0.07
370	002541	鸿路钢构	8,100	472,635.00	0.07
371	600642	申能股份	76,970	472,595.80	0.07
372	002797	第一创业	65,800	469,812.00	0.07
373	600039	四川路桥	74,900	469,623.00	0.07
374	000021	深科技	24,500	468,930.00	0.06
375	002030	达安基因	22,032	467,959.68	0.06
376	300136	信维通信	15,100	466,288.00	0.06
377	002299	圣农发展	19,500	465,660.00	0.06
378	603866	桃李面包	14,880	464,256.00	0.06
379	600549	厦门钨业	22,200	462,426.00	0.06
380	300482	万孚生物	7,060	456,711.40	0.06
381	002939	长城证券	40,600	451,878.00	0.06
381	600998	九州通	29,400	451,878.00	0.06
382	002422	科伦药业	22,544	449,752.80	0.06
383	000630	铜陵有色	165,090	449,044.80	0.06
384	600848	上海临港	25,020	447,858.00	0.06
385	002385	大北农	65,777	447,283.60	0.06
386	600895	张江高科	24,300	443,961.00	0.06
387	600516	方大炭素	59,633	443,669.52	0.06
388	600415	小商品城	86,100	443,415.00	0.06
389	603338	浙江鼎力	7,482	439,118.58	0.06
390	600536	中国软件	7,700	438,361.00	0.06
391	603712	七一二	12,100	436,810.00	0.06
392	600066	宇通客车	34,709	433,515.41	0.06
393	002429	兆驰股份	70,900	430,363.00	0.06
394	300308	中际旭创	11,104	427,726.08	0.06
395	002563	森马服饰	35,200	420,640.00	0.06
396	002266	浙富控股	84,200	420,158.00	0.06
397	600380	健康元	30,600	420,138.00	0.06
398	002463	沪电股份	27,102	419,267.94	0.06
399	600598	北大荒	27,900	417,384.00	0.06

400	002373	千方科技	24,800	414,160.00	0.06
401	000975	银泰黄金	43,520	413,875.20	0.06
402	600909	华安证券	73,770	410,898.90	0.06
403	000709	河钢股份	166,423	409,400.58	0.06
404	000999	华润三九	15,300	409,275.00	0.06
405	603218	日月股份	15,100	408,908.00	0.06
406	603858	步长制药	17,844	401,311.56	0.06
407	002010	传化智联	51,800	399,378.00	0.06
408	002926	华西证券	41,200	396,756.00	0.05
409	002925	盈趣科技	10,150	394,936.50	0.05
410	600988	赤峰黄金	26,100	391,239.00	0.05
411	600511	国药股份	11,800	390,108.00	0.05
412	002242	九阳股份	12,000	389,880.00	0.05
413	601456	国联证券	25,300	389,620.00	0.05
414	601231	环旭电子	23,100	388,311.00	0.05
415	002065	东华软件	48,866	387,507.38	0.05
416	600170	上海建工	139,600	385,296.00	0.05
417	002146	荣盛发展	68,242	384,884.88	0.05
418	600867	通化东宝	31,776	379,405.44	0.05
419	002500	山西证券	56,280	377,638.80	0.05
420	002075	沙钢股份	34,600	377,486.00	0.05
421	002127	南极电商	38,500	376,145.00	0.05
422	600801	华新水泥	21,400	375,998.00	0.05
423	002456	欧菲光	42,310	375,712.80	0.05
424	600160	巨化股份	42,300	373,932.00	0.05
425	002958	青农商行	87,200	373,216.00	0.05
426	000738	航发控制	17,900	372,857.00	0.05
427	000988	华工科技	15,700	369,264.00	0.05
428	002153	石基信息	15,632	367,508.32	0.05
429	000423	东阿阿胶	10,234	367,502.94	0.05
430	600027	华电国际	106,500	366,360.00	0.05
431	000987	越秀金控	28,900	365,874.00	0.05
432	600153	建发股份	44,935	363,973.50	0.05
433	002212	天融信	18,400	363,768.00	0.05
434	601099	太平洋	106,900	362,391.00	0.05
435	000750	国海证券	85,400	362,096.00	0.05
436	300463	迈克生物	8,600	361,974.00	0.05
437	300070	碧水源	49,500	361,845.00	0.05
438	600688	上海石化	95,700	359,832.00	0.05
439	300773	拉卡拉	12,500	352,875.00	0.05
440	600256	广汇能源	105,900	352,647.00	0.05
441	002558	巨人网络	26,500	352,450.00	0.05
442	601992	金隅集团	130,702	351,588.38	0.05

443	000961	中南建设	59,300	351,056.00	0.05
444	600859	王府井	12,100	349,448.00	0.05
445	300383	光环新网	24,200	348,238.00	0.05
446	601598	中国外运	68,600	346,430.00	0.05
447	002465	海格通信	36,148	341,960.08	0.05
448	002557	洽洽食品	7,900	340,490.00	0.05
449	603883	老百姓	6,460	340,312.80	0.05
450	002151	北斗星通	7,900	340,253.00	0.05
451	002705	新宝股份	12,900	338,625.00	0.05
452	000671	阳光城	64,500	335,400.00	0.05
453	600026	中远海能	54,300	334,488.00	0.05
454	002081	金螳螂	42,055	333,075.60	0.05
455	002019	亿帆医药	19,300	332,925.00	0.05
456	000998	隆平高科	20,600	330,424.00	0.05
457	600498	烽火通信	17,700	329,751.00	0.05
458	603027	千禾味业	12,520	329,150.80	0.05
459	002683	宏大爆破	11,700	324,909.00	0.04
460	600879	航天电子	42,600	320,352.00	0.04
461	000729	燕京啤酒	44,100	319,284.00	0.04
462	002506	协鑫集成	91,700	319,116.00	0.04
463	300088	长信科技	38,500	318,010.00	0.04
464	000402	金融街	46,900	316,575.00	0.04
465	600340	华夏幸福	60,368	316,328.32	0.04
466	600529	山东药玻	9,300	315,735.00	0.04
467	600583	海油工程	69,418	312,381.00	0.04
468	300296	利亚德	39,900	312,018.00	0.04
469	000686	东北证券	36,700	310,115.00	0.04
470	000629	攀钢钒钛	134,600	308,234.00	0.04
471	002727	一心堂	9,300	307,923.00	0.04
472	300418	昆仑万维	18,319	300,065.22	0.04
473	000540	中天金融	109,900	300,027.00	0.04
474	001914	招商积余	16,600	285,188.00	0.04
475	000623	吉林敖东	18,200	281,918.00	0.04
476	000627	天茂集团	77,400	280,188.00	0.04
477	000581	威孚高科	13,086	272,581.38	0.04
478	300212	易华录	10,120	272,329.20	0.04
479	601128	常熟银行	43,000	266,600.00	0.04
480	000401	冀东水泥	21,100	260,585.00	0.04
481	002399	海普瑞	16,300	259,659.00	0.04
482	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.03
483	601098	中南传媒	28,196	248,688.72	0.03
484	002131	利欧股份	105,900	247,806.00	0.03
485	002572	索菲亚	7,200	174,240.00	0.02

486	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.02
487	300957	贝泰妮	554	139,585.84	0.02
488	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.02
489	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
490	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
491	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.01
492	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
493	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.01
494	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
495	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
496	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
497	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
498	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
499	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
500	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
501	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
502	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
503	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
504	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
505	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
506	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
507	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
508	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
509	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
510	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
511	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
512	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
513	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
514	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
515	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
516	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
517	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
518	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
519	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
520	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
521	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
522	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
523	300925	法本信息	353	9,280.37	0.00
524	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
525	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
526	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
527	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
528	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00

529	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
530	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
531	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
532	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
533	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
534	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
535	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
536	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
537	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
538	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
539	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
540	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
541	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
542	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
543	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
544	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
545	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
546	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
547	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
548	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
549	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
550	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
551	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
552	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
553	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
554	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
555	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
556	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
557	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
558	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

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	000333	美的集团	6,330,129.00	0.75
2	000858	五粮液	6,063,118.08	0.72
3	300750	宁德时代	4,937,142.96	0.59
4	300760	迈瑞医疗	4,138,409.00	0.49
5	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.41
6	600519	贵州茅台	3,137,836.00	0.37
7	002352	顺丰控股	3,084,681.82	0.37

8	002594	比亚迪	2,803,821.00	0.33
9	601816	京沪高铁	2,749,958.00	0.33
10	000001	平安银行	2,426,570.00	0.29
11	300759	康龙化成	2,086,577.00	0.25
12	002714	牧原股份	2,005,704.60	0.24
13	300999	金龙鱼	1,915,162.00	0.23
14	300015	爱尔眼科	1,895,547.00	0.23
15	002475	立讯精密	1,865,389.00	0.22
16	000568	泸州老窖	1,771,650.00	0.21
17	002371	北方华创	1,742,327.00	0.21
18	601658	邮储银行	1,740,939.00	0.21
19	300059	东方财富	1,709,766.00	0.20
20	000002	万科 A	1,637,663.00	0.20

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	000858	五粮液	10,944,077.10	1.30
2	300750	宁德时代	8,591,070.00	1.02
3	002415	海康威视	6,909,246.76	0.82
4	600519	贵州茅台	4,565,943.00	0.54
5	002594	比亚迪	4,503,660.40	0.54
6	300760	迈瑞医疗	4,486,787.52	0.53
7	000001	平安银行	4,275,895.45	0.51
8	002714	牧原股份	3,680,006.60	0.44
9	002271	东方雨虹	3,408,264.00	0.41
10	002352	顺丰控股	3,347,156.00	0.40
11	000568	泸州老窖	3,347,077.00	0.40
12	002475	立讯精密	3,275,506.01	0.39
13	300015	爱尔眼科	3,272,448.00	0.39
14	300059	东方财富	2,993,768.00	0.36
15	000002	万科 A	2,844,602.00	0.34
16	002304	洋河股份	2,661,962.04	0.32
17	300122	智飞生物	2,423,488.00	0.29
18	002142	宁波银行	2,361,854.80	0.28
19	600050	中国联通	2,216,616.79	0.26
20	002371	北方华创	2,189,537.00	0.26

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	213,536,518.69
卖出股票的收入（成交）总额	272,361,161.14

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	-	-
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）	59,300.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,300.00	0.01

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	127038	国微转债	237	23,700.00	0.00
2	113049	长汽转债	200	20,000.00	0.00
3	123117	健帆转债	156	15,600.00	0.00
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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	沪深 300 股指期货 IF2109 合约	9	13,949,280.00	232,200.00	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。
IC2107	中证 500 股指期货 IC2107 合约	2	2,706,880.00	104,480.00	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					336,680.00
股指期货投资本期收益					1,309,572.81
股指期货投资本期公允价值变动					-760,700.00

7.10.2 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。

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, 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。本基金为指数型基金, 采取完全复制策略, 招商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	2,132,850.73
2	应收证券清算款	264,354.85
3	应收股利	-
4	应收利息	6,633.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,403,839.05

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

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		华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,751	102,110.22	140,907,329.00	36.79%	111,199,908.00	29.03%	130,908,181.00	34.18%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	77,008,000.00	20.11%

2	伦敦市投资管理有限公司 — 客户资金	18,300,000.00	4.78%
3	竞技世界（北京）网络技术 有限公司	16,711,700.00	4.36%
4	广发证券股份有限公司	12,136,402.00	3.17%
5	安英慧	5,038,800.00	1.32%
6	生命保险资管—招商银行 — 生命保险资产管理有限 公司富盈 5 号	5,000,000.00	1.31%
7	方正证券股份有限公司	3,873,576.00	1.01%
8	陈文峰	3,045,500.00	0.80%
9	张星	2,420,400.00	0.63%
10	生命保险资管—农业银行 — 生命资产价值精选资产 管理产品	2,000,000.00	0.52%
11	中国银行股份有限公司— 华夏 MSCI 中国 A 股国际 通交易型开放式指数证券 投资基金联接基金	130,908,181.00	34.18%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

8.4 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	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 和研究部门负责人持有本开放式 基金	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 9 月 17 日）基金份额总额	602,503,247.00
本报告期期初基金份额总额	474,515,418.00
本报告期基金总申购份额	108,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	199,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	383,015,418.00

§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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	21	361,743,086.67	76.44%	156,023.84	76.44%	-
广发证券	1	30,168,690.96	6.37%	13,011.81	6.37%	-
海通证券	4	28,781,218.50	6.08%	12,413.35	6.08%	-
华泰证券	4	22,988,566.60	4.86%	9,915.03	4.86%	-
中银国际证券	3	16,469,439.00	3.48%	7,103.36	3.48%	-
申万宏源证券	3	9,182,233.64	1.94%	3,960.56	1.94%	-
长江证券	1	2,190,604.91	0.46%	944.85	0.46%	-
中信建投证券	3	1,729,338.34	0.37%	745.82	0.37%	-
中国银河证券	8	-	-	-	-	-

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，本基金还选择了东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高华证券、国金证券、国盛证券、国泰君安、国泰君安证券、国信证券、华安证券、华西证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、太平洋证券、万和证券、西部证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际证券、粤开证券、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在上述租用的券商交易单元中，天风证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

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	1,531,072.29	94.79%	2,500,000.00	100.00%
广发证券	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	-	-
中国银河证券	84,172.20	5.21%	-	-

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	2021-01-04
2	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
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旗下部分上交所 ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-19
10	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
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	2021-04-02
12	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
13	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
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	2021-04-09
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	2021-04-21
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	2021-05-08
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	2021-05-12
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	2021-05-13
19	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

20	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
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	2021-05-28
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	2021-06-04
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	2021-06-09
24	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
25	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	2021-06-18
26	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	2021-06-19
27	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	2021-06-30

§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

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	2021-01-22 至 2021-01-24,2021-02-23 至 2021-03-15,2021-03-17 至 2021-03-21,2021-03-31 至 2021-04-11,2021-06-01 至 2021-06-20,2021-06-23,2021-06-28 至 2021-06-30	77,552,800.00	15,000,000.00	15,544,800.00	77,008,000.00	20.11%
华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	1	2021-01-01 至 2021-06-30	204,575,781.00	13,232,400.00	86,900,000.00	130,908,181.00	34.18%

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。

§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转型的文件；
- 2、《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏 MSCI 中国 A 股国际通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。

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