

华夏聚惠稳健目标风险混合型基金中基金(FOF)

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|-------------|
| 基金简称 | 华夏聚惠 FOF | |
| 基金主代码 | 005218 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 11 月 3 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 201,382,408.27 份 | |
| 投资目标 | 在控制风险的前提下，通过主动的资产配置、基金优选，力求基金资产稳定增值。 | |
| 投资策略 | 主要投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等。在资产配置策略上，本基金定位为“目标风险策略基金”，基金的资产配置通过结合风险预算模型与宏观基本面分析确定，同时随着市场环境的变化引入战术资产配置对组合进行适时调整。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金中基金（FOF），是目标风险系列 FOF 产品中风险较低的（目标风险系列根据不同风险程度划分为五档，分别是收入、稳健、均衡、积极、进取）。本基金以风险控制为产品主要导向，通过限制股票、股票型基金、混合型基金的投资比例在 0-30%之内控制产品风险，定位为较为稳健的 FOF 产品，适合追求较低风险的投资人。本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 华夏基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华夏聚惠 FOF(A) | 华夏聚惠 FOF(C) |
| 下属分级基金的交易代码 | 005218 | 005219 |

| | | |
|---------------------|------------------|-----------------|
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 139,316,142.04 份 | 62,066,266.23 份 |
|---------------------|------------------|-----------------|

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日) | |
|----------------|---|---------------|
| | 华夏聚惠 FOF(A) | 华夏聚惠 FOF(C) |
| 1.本期已实现收益 | 2,606,106.36 | 882,428.66 |
| 2.本期利润 | 4,833,872.29 | 1,802,225.62 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0357 | 0.0355 |
| 4.期末基金资产净值 | 199,169,221.75 | 87,264,313.77 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.4296 | 1.4060 |

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③本基金 T 日的基金份额净值在 T+3 日内公告。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏聚惠FOF(A):

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.57% | 0.46% | 1.16% | 0.17% | 1.41% | 0.29% |
| 过去六个月 | 3.56% | 0.57% | 0.98% | 0.21% | 2.58% | 0.36% |
| 过去一年 | 7.25% | 0.63% | 2.55% | 0.24% | 4.70% | 0.39% |
| 过去三年 | 45.88% | 0.58% | 22.75% | 0.26% | 23.13% | 0.32% |
| 自基金合同 生效起至今 | 42.96% | 0.51% | 21.65% | 0.26% | 21.31% | 0.25% |

华夏聚惠FOF(C):

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.46% | 0.46% | 1.16% | 0.17% | 1.30% | 0.29% |
| 过去六个月 | 3.35% | 0.57% | 0.98% | 0.21% | 2.37% | 0.36% |
| 过去一年 | 6.83% | 0.63% | 2.55% | 0.24% | 4.28% | 0.39% |
| 过去三年 | 44.13% | 0.58% | 22.75% | 0.26% | 21.38% | 0.32% |
| 自基金合同 生效起至今 | 40.60% | 0.51% | 21.65% | 0.26% | 18.95% | 0.25% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏聚惠稳健目标风险混合型基金中基金（FOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 11 月 3 日至 2021 年 12 月 31 日)

华夏聚惠FOF(A):



华夏聚惠FOF(C):



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 郑铮 | 本基金的基金经理 | 2017-11-03 | - | 20 年 | 硕士。曾任国泰君安证券有限公司分析师、通联万达科技有限公司财务总监、长盛基金管理有限公司基金经理助理、阳光资产管理股份有限公司宏观研究员等。2014年2月加入华夏基金管理有限公司。曾任投资研究部研究员、基金经理助理，资产配置部研究员、华夏聚丰稳健目标风险混合型基金中基金（FOF）基金经理(2018年10月23日至2021年2月9日期间)等。 |
| 李晓易 | 本基金的基金经理 | 2019-01-24 | - | 6 年 | 硕士。曾任中信期货有限公司资产管理部研究员、投资经理。2015年4月加入华夏基金管理有限公司。曾任资产配置部研究员。 |
| 苏瑛 | 本基金的基金经理 | 2021-11-09 | - | 11 年 | 硕士。曾任招商银行产品经理等。2015年11月加入华夏基金管理有限公司。曾任资产配置部 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|------------------|
| | | | | | 研究员、基金经理助理、投资经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------|

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 18 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

4 季度，我们观察到疫情对中国经济的负面作用开始显现，delta 病毒的隐蔽性，使得地方政府的防疫措施变得更加困难。因此我们观察到经济出现了下行的迹象，同时大宗商品的上涨预期终于被经济管理部门抑制，市场对经济从滞胀预期转向了衰退预期。另外中央经济工作会进一步释放了稳经济控风险的信号，从措辞来看，对稳经济的诉求是近年少见。因此市场博弈的核心是确定的货币流动性宽松和不确定的财政稳经济力度。我们看到权益市场的波动开始变大，主轴变得模糊，各个行业都开始有短期的表现机会，唯一确定和稳定的是长期国债利率的下行。

报告期内，本基金在基金的风格上进行了一些再平衡操作，增加了券商、传媒和传统周期行

业的配置，适度减少了新能源产业的配置。在固定收益资产方面增加了长久期资产的暴露和转债资产的暴露。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，华夏聚惠 FOF(A)基金份额净值为 1.4296 元，本报告期份额净值增长率为 2.57%；华夏聚惠 FOF(C)基金份额净值为 1.4060 元，本报告期份额净值增长率为 2.46%，同期业绩比较基准增长率为 1.16%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,190,224.00 | 0.41 |
| | 其中：股票 | 1,190,224.00 | 0.41 |
| 2 | 基金投资 | 246,698,008.70 | 85.87 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 38,522,973.73 | 13.41 |
| 8 | 其他各项资产 | 865,839.42 | 0.30 |
| 9 | 合计 | 287,277,045.85 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 962,304.00 | 0.34 |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 227,920.00 | 0.08 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,190,224.00 | 0.42 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 603979 | 金诚信 | 44,800 | 962,304.00 | 0.34 |
| 2 | 002939 | 长城证券 | 17,600 | 227,920.00 | 0.08 |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |
| 6 | - | - | - | - | - |
| 7 | - | - | - | - | - |
| 8 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|----|---|---|---|---|---|
| 9 | - | - | - | - | - |
| 10 | - | - | - | - | - |

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,201.64 |
| 2 | 应收证券清算款 | 38,672.81 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,622.91 |
| 5 | 应收申购款 | 822,342.06 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 865,839.42 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额 (份) | 公允价值 (元) | 占基金资产 净值比例 (%) | 是否属于 基金管理人及管理人关联方 所管理的 基金 |
|----|--------|-------------------|------------|---------------|---------------|----------------------|------------------------------------|
| 1 | 002459 | 华夏鼎利 债券 A | 契约型开 放式 | 23,568,777.14 | 33,279,113.32 | 11.62 | 是 |
| 2 | 004885 | 长信先优 债券 | 契约型开 放式 | 14,015,275.68 | 16,155,408.28 | 5.64 | 否 |
| 3 | 001532 | 华安文体 健康混合 A | 契约型开 放式 | 3,206,277.16 | 13,652,328.15 | 4.77 | 否 |
| 4 | 000186 | 华泰柏瑞 | 契约型开 | 12,449,404.72 | 13,355,721.38 | 4.66 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|--------------|--------|--------------|---------------|------|---|
| | | 季季红债券 | 放式 | | | | |
| 5 | 110027 | 易方达安心回报债券 A | 契约型开放式 | 6,433,206.75 | 12,834,247.47 | 4.48 | 否 |
| 6 | 519967 | 长信利富债券 | 契约型开放式 | 7,376,296.52 | 10,538,514.84 | 3.68 | 否 |
| 7 | 000385 | 景顺长城景颐双利债券 A | 契约型开放式 | 6,542,176.95 | 10,310,470.87 | 3.60 | 否 |
| 8 | 001045 | 华夏可转债增强债券 A | 契约型开放式 | 5,710,737.97 | 10,016,634.40 | 3.50 | 是 |
| 9 | 002351 | 易方达裕祥回报债券 | 契约型开放式 | 5,744,269.34 | 9,995,028.65 | 3.49 | 否 |
| 10 | 001811 | 中欧明睿新常态混合 A | 契约型开放式 | 2,780,002.00 | 9,631,594.93 | 3.36 | 否 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | 2,899.73 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 10,320.80 | 4.60 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 507,544.46 | 144,017.02 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 99,804.38 | 30,822.64 |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF

除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华夏聚惠FOF(A) | 华夏聚惠FOF(C) |
|----------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 135,888,216.50 | 47,987,901.37 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 9,628,777.56 | 17,984,664.50 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 6,200,852.02 | 3,906,299.64 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 139,316,142.04 | 62,066,266.23 |

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2021 年 11 月 11 日发布华夏基金管理有限公司关于增聘华夏聚惠稳健目标风险混合型基金中基金（FOF）基金经理的公告。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金

管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，首批公募 MOM 基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 1/35；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 1/176、华夏兴华混合（A 类）排序第 32/176；在定期开放式偏股型基金（A 类）中华夏磐利一年定开混合（A 类）排序第 1/63、华夏成长精选 6 个月定开混合（A 类）排序第 17/63；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 2/692、华夏盛世混合排序第 14/692；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票（A 类）排序第 6/33；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 10/132；在标准股票型基金（A 类）中华夏智胜价值成长股票（A 类）排序第 41/259；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 79/499。

指数与量化策略产品：在信用债指数债券型基金（A 类）中华夏亚债中国指数（A 类）排序第 2/18；在策略指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏创成长 ETF 联接（A 类）排序第 3/14；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强（A 类）排序第 4/103；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 4/95、华夏中证四川国改 ETF 排序第 7/95、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 10/95；在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 5/23；在主题指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证四川国改 ETF 联接（A 类）排序第 5/55、华夏国证半导体芯片 ETF 联接（A 类）排序第 7/55；在定期开放式绝对收益目标基金（A 类）中华夏安泰对冲策略

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

固收&“固收+”产品：在QDII债券型基金（A类）中华夏大中华信用债券（QDII）（A类）排序第1/25、华夏收益债券（QDII）（A类）排序第4/25；在偏债型基金（A类）中华夏永康添福混合排序第4/231、华夏磐泰混合（LOF）（A类）排序第20/231、华夏睿磐泰茂混合（A类）排序第26/231、华夏睿磐泰利混合（A类）排序第29/231、华夏睿磐泰兴混合排序第34/231；在长期纯债债券型基金（A类）中华夏鼎航债券（A类）排序第29/615、华夏鼎茂债券（A类）排序第85/615；在短期纯债债券型基金（A类）中华夏短债债券（A类）排序第8/54；在普通债券型基金（可投转债）（A类）中华夏聚利债券排序第14/203、华夏双债债券（A类）排序第32/203；在普通债券型基金（二级）（A类）中华夏鼎泓债券（A类）排序第31/258；在定期开放式纯债债券型基金（A类）中华夏鼎瑞三个月定期开放债券（A类）排序第80/427。

养老&FOF产品：在混合型FOF（权益资产0-30%）（A类）中华夏聚丰混合（FOF）（A类）排序第1/16、华夏聚惠FOF（A类）排序第3/16；在养老目标日期FOF（2040）（A类）中华夏养老2040三年持有混合（FOF）排序第2/11。

在客户服务方面，4季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销上线交通银行卡快捷支付业务，交易额度进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端上线非活期通基金的预约赎回功能，增加客户操作便利性；（3）与排排网基金销售等销售机构开展代销合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“披荆斩棘的投资人”、“华夏亲子财商营”、“定投的良辰吉日”等活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏聚惠稳健目标风险混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《华夏聚惠稳健目标风险混合型基金中基金（FOF）托管协议》；

- 4、法律意见书;
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇二二年一月二十一日