

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

报告送出日期：二〇二二年三月三十日

§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。本年度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 2022 年 3 月 28 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
§5 托管人报告.....	16
§6 审计报告.....	17
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
§8 投资组合报告.....	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
8.6 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.....	61
8.7 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
8.8 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
8.9 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
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
8.12 投资组合报告附注.....	62
§9 基金份额持有人信息.....	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
9.3 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情况.....	63
§10 开放式基金份额变动.....	64
§11 重大事件揭示.....	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§13 备查文件目录.....	68

§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	95,793,132.77 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	40,891,801.09 份	54,901,331.68 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、存托凭证投资策略、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
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年		2020 年		2019 年 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 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	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	6,823,623.21	9,494,819.64	4,475,751.22	6,166,262.70	203,493.96	217,865.27
本期利润	916,120.49	2,402,908.15	6,403,192.41	8,291,244.05	1,929,255.74	2,514,235.26
加权平均基金份额本期利润	0.0206	0.0368	0.2129	0.1963	0.0446	0.0355
本期加权平均净利润	1.52%	2.73%	18.86%	17.31%	4.53%	3.61%

率						
本期基金份额净值增长率	6.60%	6.29%	22.08%	21.70%	5.06%	4.92%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	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	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	12,635,546.26	16,404,056.11	4,406,221.68	8,563,411.31	188,738.18	188,167.97
期末可供分配基金份额利润	0.3090	0.2988	0.1593	0.1541	0.0049	0.0036
期末基金资产净值	55,910,189.20	74,511,845.94	35,479,400.00	70,982,877.03	40,139,846.10	55,214,116.76
期末基金份额净值	1.3673	1.3572	1.2826	1.2769	1.0506	1.0492
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	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	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	36.73%	35.72%	28.26%	27.69%	5.06%	4.92%

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
过去三个月	-1.04%	0.73%	-1.29%	0.75%	0.25%	-0.02%
过去六个月	-1.38%	0.97%	-4.79%	1.00%	3.41%	-0.03%
过去一年	6.60%	1.01%	-1.81%	1.02%	8.41%	-0.01%
自基金合同生效起至今	36.73%	1.13%	19.67%	1.12%	17.06%	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
过去三个月	-1.12%	0.73%	-1.29%	0.75%	0.17%	-0.02%
过去六个月	-1.53%	0.97%	-4.79%	1.00%	3.26%	-0.03%
过去一年	6.29%	1.01%	-1.81%	1.02%	8.10%	-0.01%
自基金合同生效起至今	35.72%	1.13%	19.67%	1.12%	16.05%	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

基金份额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

(2019 年 7 月 16 日至 2021 年 12 月 31 日)

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A



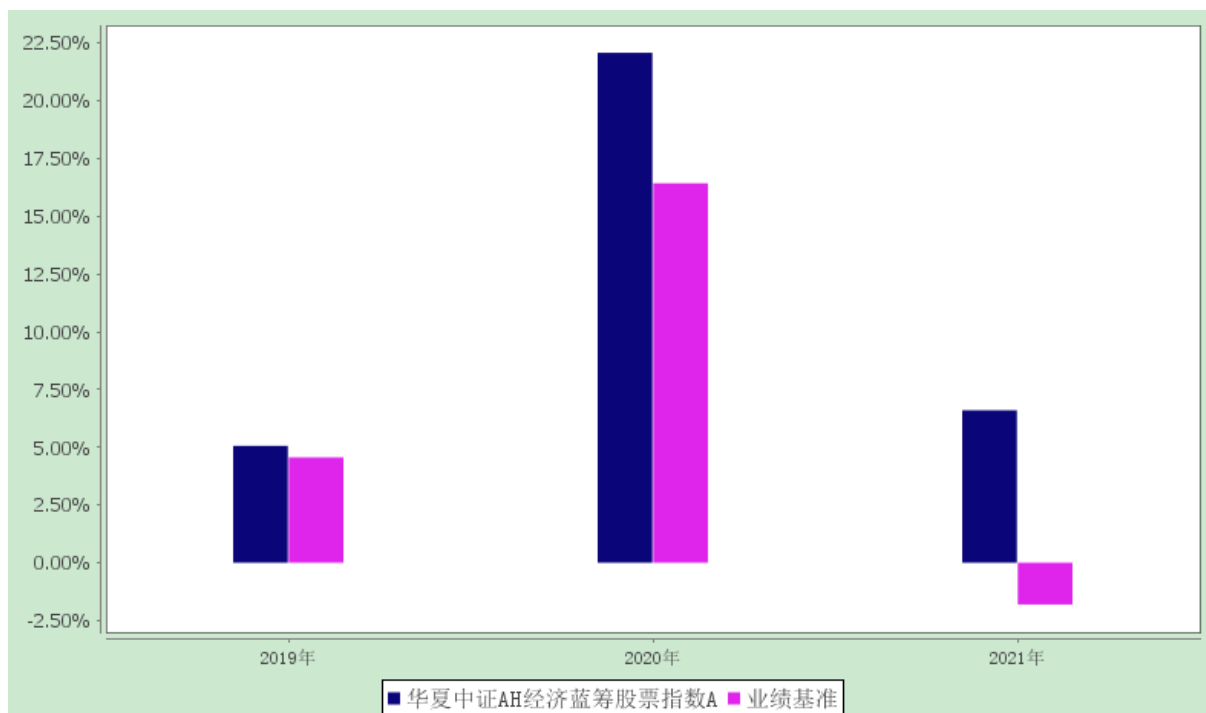
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C



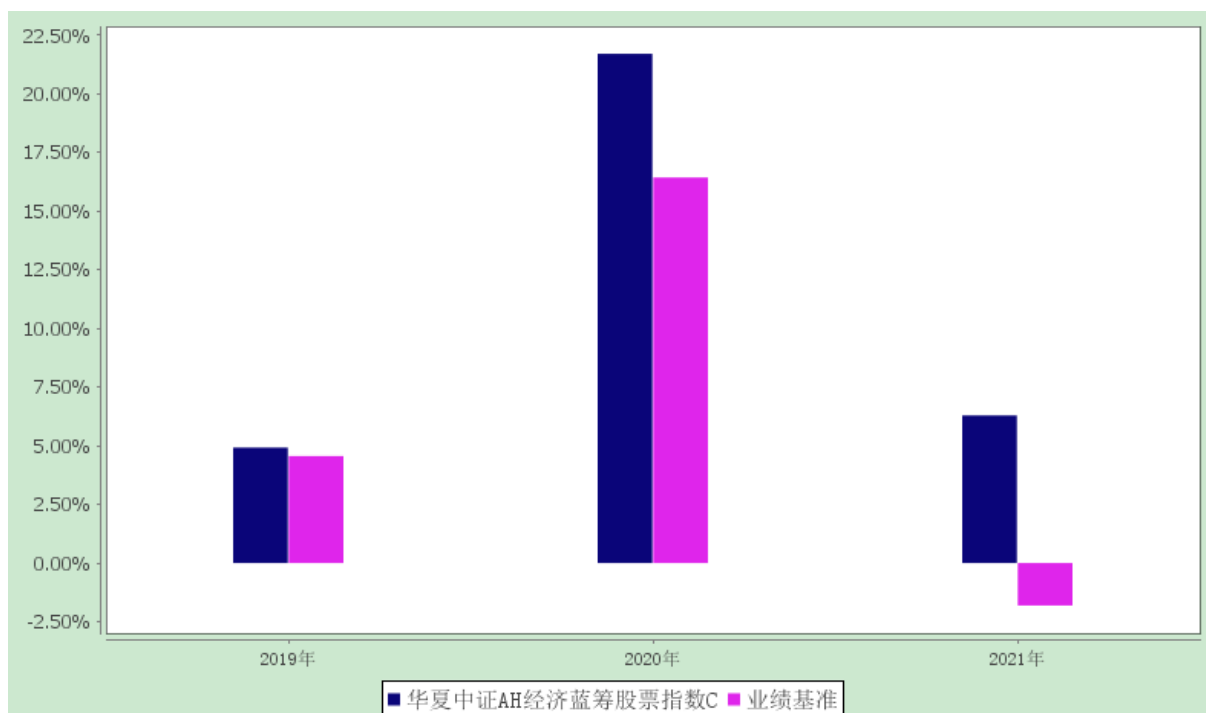
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金
基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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



注：本基金合同于 2019 年 7 月 16 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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，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、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 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，2021 年，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）华夏基金直销上线邮储银行卡直连、交通银行卡快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端上线人脸识别，盖章账单自动生成，非货基收益提醒及预约赎回等功能，提升了投资者业务办理的方便快捷性，在震荡的市场行情下方便投资者及时掌握基金收益情况，增加客户操作便利性；（3）与民商基金销售、众惠基金、泰信财富、排排网基金销售等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“震荡市需要口服镇心丸”、“发个暗号，看多少人在嗑这对 CP？”、“牙掉了之后”、“准备好了吗？来跟我们一起碳中和！”、“华夏亲子财商营”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		

<p>荣膺</p>	<p>本基金的基金经理、投委会成员</p>	<p>2020-12-08</p>	<p>-</p>	<p>11 年</p> <p>硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）等。</p>
-----------	-----------------------	-------------------	----------	---

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 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 73 次，其中 52 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。

A 股方面，表现为整体稳定，分化加大。行业维度，受益于碳中和政策的新兴行业与传统行业花开两朵。新兴行业如新能源车、光伏、车用芯片走强，传统行业走强的则是受益于供给收缩预期而涨价的煤炭、钢铁、化工等，受益于绿电政策的绿电及电网系统等。风格维度，主要表现为大小盘股定价体系的收敛，众多碳中和产业链的中小公司迎来估值和盈利的双升，成长和价值风格均有表现。港股方面，整体表现低迷。港股权重板块主要由高估值的互联网及创新药行业和金融地产产业链构成。二者在 2021 年均表现低迷，拖累港股市场。

2021 年，投资者也在投资实践中对指数基金和主动基金的特性进一步加深理解。

历史数据显示，指数与主动基金的年度胜率相当，主动基金收益率更高。用偏股混合型基金指数代表公募主动基金平均收益，与沪深 300 指数作比较。2005 年到 2021 年的这 17 年间，主动股基累计取得了 11.67 倍的收益，沪深 300 是 5.55 倍，主动基金经理的确能取得显著的超额收益。按年份看，主动基金的年胜率是 52%，9 年跑赢沪深 300、7 年输、1 年平。不过，如果把统计时间缩小到 2005-2018 年，主动 4.20 倍，指数 2.76 倍，算术平均年超额收益 10%。2019-2021 年，主动连续三年跑赢沪深 300，算术平均年超额收益 23%，这在历史上是前所未有的。合理的猜测原因可能是由于以新能源为代表的一大批新兴产业的发展很快，主动基金抢先挖掘投资机会，指数尚未来得及调整成分结构，阶段性大幅落后主动基金。出于平滑年度收益的考虑，不应笼统的因主动基金过往收益高而否定指数基金的投资价值。

从产业发展的生命周期角度，指数和主动基金在不同的阶段分别存在投资机会。新兴产业发展大致分为以下三个阶段。第一阶段，产业出现新的变革，主动基金经理具备识别龙头公司的能力，可以率先发现产业变革的机会；第二阶段，股价逐渐走出趋势，动量因子的量化模型会捕捉到这种趋势，增强了市场动量；第三阶段，产业趋势明朗并被大众认知，产业变化速度下降，领先者强者恒强，主动基金跑赢指数基金的难度加大，指数基金的优势显现。在投资的过程中，我们并不能十分明确地知道产业变革何时出现、出现的方向、持续时间、变革的进度等问题，在投资决策时最好的办法是模糊处理，即主动和指数两头下注。

从市场牛熊周期的角度，宽基指数、窄基指数和主动股基的性价比交替出现。宽基指数基金一大优势是熊市尾声抄底的最佳工具。投资始终比较的是系统性机会和超额收益的幅度和确定性。熊

市尾声，市场系统性的低估值是确定的，同时未来赢率改善也是确定的，而未来领涨的行业并不清晰，没有必要暴露行业和个股风险，因此熊市尾声阶段，宽基指数基金确定性优于主动股基。随着行情的演绎，主线逐渐清晰，适合集中而不是分散均衡。此时行业窄基指数和风格指数、具备超额收益能力的主动股基的性价比将超过宽基指数。当市场进入到磨顶及下跌阶段，市场风险逐步加大，应当再度分散投资，宽基指数的性价比逐渐再度提升。

经过十几年的不懈努力，指数基金也经历了由简单被动复制市场到主动策略性增强的阶段。以创成长指数为例，自 2019 年 7 月 15 日相关 ETF 上市至 2021 年末，累计收益 178%，同期创业板指数涨幅 119%，偏股混合型基金指数涨幅 96%，远远跑赢市场表征指数及公募基金平均水平。此外，2019-2021 年一批优质的行业、主题指数基金也应运而生，标的指数很好地刻画了产业赛道整体表现，成分股筛选时同样具备选优排雷操作，成为投资者布局这些赛道的一大选择。

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 12 月 31 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 份额净值为 1.3673 元，本报告期份额净值增长率为 6.60%，同期业绩比较基准增长率-1.81%，本报告期跟踪偏离度为+8.41%；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 份额净值为 1.3572 元，本报告期份额净值增长率为 6.29%，同期业绩比较基准增长率-1.81%，本报告期跟踪偏离度为+8.10%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中周期视角，中国处于经济复苏阶段早期，未来经济有望磨底，基本面会越来越越好，美国在经济下行的早期，未来经济难免不出现持续下滑，基本面会越来越差。当前中国经济周期相位暂不占优，因此美国敢于采取紧缩的货币政策，由此产生的边际影响，对中国可能造成压力。未来中国经济周期位置逐渐占优。随着美国持续施行紧缩的货币政策，势必对美国自身经济产生反作用力，中国相对宽松的财政和货币政策逐渐见效后，中美优劣位置将逆转。应对策略方面，在中国托底政策对国内经济的正面拉动尚未完全见效、美国紧缩政策对美国经济的负面影响还未真正显现之前，对国内 A 股市场应采取谨慎态度，避免仓位过重、行业风格过于集中、交易过于频繁；在中国相对美国经济周期位置出现改善信号后，可以逐步采取更加积极的态度。

美联储加息缩表成为 2022 年 A 股运行的最大扰动项。美国紧缩的货币政策对 A 股的影响，可以从实体经济和资本市场两条传导路径进行探讨。实体经济途径，美联储紧缩的货币政策，导致美国经济下行，美国进口减少，一方面，在总需求端，中国出口需求减少，中国经济下行压力加大，

上市公司业绩增长压力加大；另一方面，流动性层面，中国出口结售汇减少，国内货币信用派生压力加大，市场估值压力加大。结合起来，美联储紧缩的货币政策会使得国内 A 股面临业绩和估值的双重压力。资本市场途径，美联储流动性收紧会加大美国金融资产波动，分别从股债汇三个市场进行传导，美股下跌令 A 股风险偏好下降，美债利率上行对 A 股中以美债利率定价的高估值板块承压，美元阶段性升值加大北上资金流出压力。

尽管美联储加息对 A 股会产生种种负面影响，需要明确的是，内因决定事物的性质和发展方向，外因对事物的发展起加速或延缓作用。大方向应看到国内以经济建设为中心的主基调，对 2022 年战略性保持乐观态度；同时看到美联储的紧缩带来的负面影响，战术上保持谨慎。节奏方面，根据以往经验判断，在 1 月美联储确定加息、3 月美联储第一次加息等时点，A 股波动可能会相对剧烈。第二次加息落地后，市场可能会逐渐降低对美联储政策的敏感度，主要矛盾重回国内，直至完全脱敏。届时国内稳增长政策也会逐步见效，美联储加息对自身经济的伤害陆续显现，很可能会出现中美强弱角色互换。应对策略，在中国市场对美联储加息政策敏感阶段，采取相对防御的策略，关注低估值的宽基指数，低估值高股息的公司利率上行、市场波动加大的环境里具有很好的抗风险属性，反而有可能在今年得到定价中枢抬升，甚至不妨可关注港股宽基如恒生指数、恒生中国企业指数等，2021 年港股市场通过杀估值很大程度上消化了各类负面压力，美联储加息对港股的资金抽水效应可能会比以往加息阶段都要弱；当中国市场对加息逐渐脱敏后，采取更为积极的进攻策略。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司着力加强合规制度建设，在投资、销售、员工行为合规管理等方面出台多项管理制度。同时，继续强化业务部门专兼合规管理职责，规范任免流程，提高工作质量，完善合规管理组织机制。公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。公司开展多种形式的法律法规和廉洁从业培训，提升员工的合规意识，促进廉洁从业。公司严格落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，排查业务风险隐患，促

进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 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，本基金管理人作为准确、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。会计师事务所对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。

4.8 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。

§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 12 月 31 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 托管人对本年度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年度报告中的财务指标、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，未发现有害

基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天审字（2022）第 24716 号

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金(以下简称“华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

单峰 朱宏宇

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2022 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	10,506,235.77	7,678,224.20
结算备付金		51,529.32	38,374.53
存出保证金		66,179.50	8,802.29
交易性金融资产	7.4.7.2	120,077,514.43	99,508,654.64
其中：股票投资		120,071,914.43	99,402,654.64
基金投资		-	-
债券投资		5,600.00	106,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		72,522.16	969,760.07
应收利息	7.4.7.5	2,889.88	1,775.32
应收股利		17,477.40	13,852.77
应收申购款		-	235,847.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		130,794,348.46	108,455,291.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7.33	0.28
应付赎回款		-	1,753,587.51
应付管理人报酬		69,442.37	44,633.73
应付托管费		13,888.47	8,926.75
应付销售服务费		21,673.00	17,617.67
应付交易费用	7.4.7.7	87,302.15	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	7.4.7.8	180,000.00	141,241.23
负债合计		372,313.32	1,993,014.28
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	95,793,132.77	83,250,997.15
未分配利润	7.4.7.10	34,628,902.37	23,211,279.88
所有者权益合计		130,422,035.14	106,462,277.03
负债和所有者权益总计		130,794,348.46	108,455,291.31

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 基金份额净值 1.3673 元，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 基金份额净值 1.3572 元；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数基金份额总额 95,793,132.77 份（其中 A 类 40,891,801.09 份，C 类 54,901,331.68 份）。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		5,223,535.44	15,692,353.50
1.利息收入		88,070.49	42,784.26
其中：存款利息收入	7.4.7.11	87,807.13	42,623.90
债券利息收入		263.36	160.36
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）		17,975,147.54	11,566,090.22
其中：股票投资收益	7.4.7.12	14,757,730.38	9,979,697.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	4,861.19	10,757.03
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-205,260.00	-
股利收益	7.4.7.16	3,417,815.97	1,575,635.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-12,999,414.21	4,052,422.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	159,731.62	31,056.48

减：二、费用		1,904,506.80	997,917.04
1.管理人报酬		738,958.42	408,917.30
2.托管费		147,791.64	81,783.49
3.销售服务费		264,076.51	143,487.88
4.交易费用	7.4.7.19	530,447.43	184,590.69
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	0.02
7.其他费用	7.4.7.20	223,232.77	179,137.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,319,028.64	14,694,436.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,319,028.64	14,694,436.46

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	3,319,028.64	3,319,028.64
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）	12,542,135.62	8,098,593.85	20,640,729.47
其中：1.基金申购款	183,140,405.79	67,183,526.07	250,323,931.86
2.基金赎回款	-170,598,270.17	-59,084,932.22	-229,683,202.39
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）	95,793,132.77	34,628,902.37	130,422,035.14
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	14,694,436.46	14,694,436.46
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）	-7,579,789.62	3,993,667.33	-3,586,122.29
其中：1.基金申购款	86,593,336.66	15,305,334.22	101,898,670.88
2.基金赎回款	-94,173,126.28	-11,311,666.89	-105,484,793.17
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）	83,250,997.15	23,211,279.88	106,462,277.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 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(合同业存单)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。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融

负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况参考《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<

证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种,按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

4、本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化,或者实施具有追溯力的修订,从而导致本基金在正常的经营活动中,部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时,本基金需要作出相关会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	10,506,235.77	7,678,224.20
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	10,506,235.77	7,678,224.20

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	124,996,774.33	120,071,914.43	-4,924,859.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,600.00	5,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	5,600.00	5,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	125,002,374.33	120,077,514.43	-4,924,859.90
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	91,328,100.33	99,402,654.64	8,074,554.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	106,000.00	106,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	106,000.00	106,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	91,434,100.33	99,508,654.64	8,074,554.31
----	---------------	---------------	--------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,357.94	1,737.22
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	515.84	25.45
应收债券利息	0.70	8.36
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	15.40	4.29
合计	2,889.88	1,775.32

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	87,302.15	27,006.91
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	87,302.15	27,006.91

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	1,241.23
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	170,000.00	130,000.00
应付指数使用费	10,000.00	10,000.00
合计	180,000.00	141,241.23

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,663,098.16	27,663,098.16
本期申购	89,443,739.47	89,443,739.47
本期赎回（以“-”号填列）	-76,215,036.54	-76,215,036.54
本期末	40,891,801.09	40,891,801.09

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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,587,898.99	55,587,898.99
本期申购	93,696,666.32	93,696,666.32
本期赎回（以“-”号填列）	-94,383,233.63	-94,383,233.63
本期末	54,901,331.68	54,901,331.68

7.4.7.10 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	6,823,623.21	-5,907,502.72	916,120.49
本期基金份额交易产生的变动数	1,405,701.37	4,880,264.41	6,285,965.78
其中：基金申购款	22,087,327.01	11,027,589.91	33,114,916.92
基金赎回款	-20,681,625.64	-6,147,325.50	-26,828,951.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,635,546.26	2,382,841.85	15,018,388.11

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	9,494,819.64	-7,091,911.49	2,402,908.15
本期基金份额交易产生的变动数	-1,654,174.84	3,466,802.91	1,812,628.07
其中：基金申购款	19,820,487.73	14,248,121.42	34,068,609.15
基金赎回款	-21,474,662.57	-10,781,318.51	-32,255,981.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,404,056.11	3,206,458.15	19,610,514.26

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	75,779.08	38,985.62
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	11,364.21	3,338.21
其他	663.84	300.07
合计	87,807.13	42,623.90

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	14,757,730.38	9,979,697.87
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
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	14,757,730.38	9,979,697.87

7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	209,505,354.86	80,198,524.71
减：卖出股票成本总额	194,747,624.48	70,218,826.84
买卖股票差价收入	14,757,730.38	9,979,697.87

7.4.7.13 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12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	300,231.21	211,800.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	294,080.00	197,152.00
减：应收利息总额	1,290.02	3,891.25
买卖债券差价收入	4,861.19	10,757.03

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	-205,260.00	-
合计	-205,260.00	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
股票投资产生的股利收益	3,417,815.97	1,575,635.32
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	3,417,815.97	1,575,635.32

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
1.交易性金融资产	-12,999,414.21	4,052,422.54
——股票投资	-12,999,414.21	4,053,036.30
——债券投资	-	-613.76

——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	-12,999,414.21	4,052,422.54

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	159,731.62	31,052.48
其他	-	4.00
合计	159,731.62	31,056.48

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	530,447.43	184,590.69
银行间市场交易费用	-	-
合计	530,447.43	184,590.69

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	13,232.77	8,737.66
指数使用费	40,000.00	40,000.00
其他	-	400.00
合计	223,232.77	179,137.66

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	295,455,549.91	68.52%	1,722,272.55	1.13%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	292,848.58	73.39%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 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12月31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	133,513.01	69.22%	32,480.97	37.21%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	1.44%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	738,958.42	408,917.30
其中：支付销售机构的客户维护费	186,520.98	113,817.14

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	147,791.64	81,783.49

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。

7.4.10.2.3 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12月31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	-	54,126.52	54,126.52
中信证券	-	317.53	317.53
华夏财富	-	14.05	14.05
中信证券（华南）	-	6.70	6.70
合计	-	54,464.80	54,464.80
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12月31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	-	5,707.82	5,707.82
华夏财富	-	75.04	75.04
中信证券	-	11.12	11.12
合计	-	5,793.98	5,793.98

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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额比例	24.46%	-	36.16%	-

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	10,506,235.77	75,779.08	7,678,224.20	38,985.62

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。

7.4.10.7 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12月31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	新股发行	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	601825	沪农商行	新股发行	15,480	137,772.00
中信证券	601728	中国电信	新股发行	29,000	131,370.00
中信证券	688739	成大生物	新股发行	988	108,680.00
中信证券	688187	时代电气	新股发行	3,104	97,403.52

中信证券	688798	艾为电子	新股发行	751	57,511.58
中信证券	688779	长远锂科	新股发行	9,879	55,816.35
中信证券	600955	维远股份	新股发行	1,694	50,074.64
中信证券	688776	国光电气	新股发行	844	43,415.36
中信证券	605555	德昌股份	新股发行	655	21,189.25
中信证券	600935	华塑股份	新股发行	4,811	18,955.34
中信证券	605566	福莱蒾特	新股发行	435	14,011.35
中信证券	605060	联德股份	新股发行	883	13,765.97
中信证券	605599	菜百股份	新股发行	980	9,800.00
中信证券	605488	福莱新材	新股发行	416	8,498.88
中信证券	605138	盛泰集团	新股发行	723	7,208.31
中信证券	001208	华菱线缆	新股发行	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	新股发行	1,101	5,086.62
中信证券	001219	青岛食品	新股发行	272	4,678.40
中信证券	601279	英利汽车	新股发行	2,004	4,148.28
中信证券	688425	铁建重工	新股发行	500	1,435.00
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	605136	丽人丽妆	新股发行	867	10,603.41
中信证券	003013	地铁设计	新股发行	724	9,723.32
中信证券	605099	共创草坪	新股发行	624	9,634.56
中信证券	003018	金富科技	新股发行	1,027	9,171.11
中信证券	600999	招商证券	配股发行	1,110	8,280.60
中信证券	003015	日久光电	新股发行	1,128	7,410.96
中信证券	605299	舒华体育	新股发行	738	5,365.26
中信证券	003006	百亚股份	新股发行	804	5,314.44

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 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 562,533.00 元，占基金资产净值的比例为 0.43%（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 12 月 31 日，本基金持有的农业银行股票估值总额为人民币 332,514.00 元，占基金资产净值的比例为 0.25%（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%）。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688162	巨一科技	2021-11-03	2022-05-10	新发流通受限	46.00	82.55	1,758	80,868.00	145,122.90	-
688121	卓然股份	2021-08-30	2022-03-07	新发流通受限	18.16	36.42	2,331	42,330.96	84,895.02	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新发流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
7.4.12.1.2 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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123132	回盛转债	2021-12-17	2022-01-07	新发流通受限	100.00	100.00	51	5,100.00	5,100.00	-
127052	杭锅转债	2021-12-24	2022-01-24	新发流通受限	100.00	100.00	5	500.00	500.00	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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“7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 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	-	32,882,946.48	32,882,946.48
衍生金融资产	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	-	-	-
应收股利	-	17,477.40	17,477.40
应收申购款	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产合计	-	32,900,423.88	32,900,423.88
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	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	-	-	-

7.4.13.4.2.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	港币相对人民币升值 5%	1,645,021.19	1,755,684.99
	港币相对人民币贬值 5%	-1,645,021.19	-1,755,684.99

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	120,071,914.43	92.06	99,402,654.64	93.37
交易性金融资产—债券投资	5,600.00	0.00	106,000.00	0.10
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
合计	120,077,514.43	92.07	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。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	-5%	-5,472,309.44	-5,346,860.58
	+5%	5,472,309.44	5,346,860.58

7.4.14 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 12 月 31 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 119,847,496.51 元，第二层次的余额为 230,017.92 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。

(5) 新金融工具准则

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	120,071,914.43	91.80
	其中：股票	120,071,914.43	91.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,600.00	0.00
	其中：债券	5,600.00	0.00
	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	10,557,765.09	8.07
8	其他各项资产	159,068.94	0.12
9	合计	130,794,348.46	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 32,882,946.48 元，占基金资

产净值比例为 25.21%。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,672,146.00	2.05
B	采矿业	3,259,017.00	2.50
C	制造业	34,086,036.18	26.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,363,432.00	1.81
E	建筑业	9,693,269.41	7.43
F	批发和零售业	9,980,186.08	7.65
G	交通运输、仓储和邮政业	2,971,146.14	2.28
H	住宿和餐饮业	262,106.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,133,952.80	3.17
J	金融业	9,592,641.50	7.36
K	房地产业	4,295,039.00	3.29
L	租赁和商务服务业	3,303,783.00	2.53
M	科学研究和技术服务业	211,746.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	262,915.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	58,261.84	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	43,290.00	0.03
	合计	87,188,967.95	66.85

8.2.2 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 (%)
通讯服务	14,324,679.04	10.98
非必需消费品	5,395,116.75	4.14
保健	2,574,059.08	1.97
房地产	2,414,961.47	1.85
材料	1,898,151.60	1.46
必需消费品	1,662,434.25	1.27
信息技术	1,488,493.13	1.14
工业	1,402,000.04	1.07
公用事业	968,038.40	0.74
能源	755,012.72	0.58
金融	-	-
合计	32,882,946.48	25.21

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

8.3 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	34,300	12,810,353.02	9.82
2	601939	建设银行	493,500	2,891,910.00	2.22
3	601668	中国建筑	451,300	2,256,500.00	1.73
4	601888	中国中免	9,800	2,150,218.00	1.65
5	03690	美团-W	9,800	1,806,012.99	1.38
6	000002	万科 A	91,300	1,804,088.00	1.38
7	601390	中国中铁	299,100	1,731,789.00	1.33
8	601318	中国平安	31,900	1,608,079.00	1.23
9	601186	中国铁建	195,500	1,524,900.00	1.17
10	002311	海大集团	18,200	1,334,060.00	1.02
11	600827	百联股份	97,100	1,294,343.00	0.99
12	002385	大北农	120,100	1,259,849.00	0.97
13	601669	中国电建	155,500	1,256,440.00	0.96
14	03323	中国建材	152,000	1,188,070.91	0.91
15	600028	中国石化	278,500	1,178,055.00	0.90
16	600019	宝钢股份	158,661	1,136,012.76	0.87
17	601919	中远海控	54,750	1,023,277.50	0.78
18	00941	中国移动	25,500	975,723.84	0.75
19	002299	圣农发展	38,800	937,796.00	0.72
20	600048	保利发展	57,600	900,288.00	0.69
21	01099	国药控股	63,600	881,909.15	0.68
22	600036	招商银行	17,300	842,683.00	0.65
23	06110	滔搏	129,000	832,161.46	0.64
24	600519	贵州茅台	400	820,000.00	0.63
25	601618	中国中冶	208,200	797,406.00	0.61
26	002251	步步高	114,800	782,936.00	0.60
27	000930	中粮科技	69,500	755,465.00	0.58
28	00883	中国海洋石油	115,000	755,012.72	0.58
29	02007	碧桂园	132,000	746,828.54	0.57
30	600104	上汽集团	36,200	746,806.00	0.57
31	000501	鄂武商 A	71,000	746,210.00	0.57
32	601800	中国交建	81,900	702,702.00	0.54
33	01109	华润置地	26,000	697,249.28	0.53
34	01958	北京汽车	241,500	661,458.84	0.51
35	600153	建发股份	72,300	655,761.00	0.50
36	601398	工商银行	139,300	644,959.00	0.49
37	00493	国美零售	1,165,000	628,652.64	0.48
38	06808	高鑫零售	244,500	625,697.02	0.48
39	601857	中国石油	125,400	615,714.00	0.47

40	600606	绿地控股	138,280	600,135.20	0.46
41	600325	华发股份	97,900	589,358.00	0.45
42	600859	王府井	21,200	572,400.00	0.44
43	600030	中信证券	21,300	562,533.00	0.43
44	002100	天康生物	52,400	560,680.00	0.43
45	000725	京东方 A	110,200	556,510.00	0.43
46	601899	紫金矿业	57,200	554,840.00	0.43
47	600585	海螺水泥	13,700	552,110.00	0.42
48	600887	伊利股份	13,100	543,126.00	0.42
49	600737	中粮糖业	57,500	540,500.00	0.41
50	00788	中国铁塔	766,000	538,602.18	0.41
51	00688	中国海外发展	35,500	535,797.81	0.41
52	600729	重庆百货	20,300	528,206.00	0.40
53	600837	海通证券	41,700	511,242.00	0.39
54	600309	万华化学	4,900	494,900.00	0.38
55	002419	天虹股份	77,100	484,188.00	0.37
56	600900	长江电力	21,000	476,700.00	0.37
57	000932	华菱钢铁	91,900	469,609.00	0.36
58	000338	潍柴动力	26,100	466,929.00	0.36
59	601868	中国能建	170,917	466,603.41	0.36
60	000333	美的集团	6,300	465,003.00	0.36
61	000829	天音控股	24,900	459,156.00	0.35
62	300226	上海钢联	11,260	457,719.00	0.35
63	600755	厦门国贸	62,800	452,788.00	0.35
64	601088	中国神华	19,600	441,392.00	0.34
65	600011	华能国际	45,200	437,988.00	0.34
66	00960	龙湖集团	14,500	435,085.84	0.33
67	601600	中国铝业	70,700	430,563.00	0.33
68	000709	河钢股份	174,300	428,778.00	0.33
69	002127	南极电商	60,800	419,520.00	0.32
70	001979	招商蛇口	30,400	405,536.00	0.31
71	002594	比亚迪	1,500	402,180.00	0.31
72	000858	五粮液	1,800	400,788.00	0.31
73	600337	美克家居	110,300	387,153.00	0.30
74	603609	禾丰股份	37,300	381,952.00	0.29
75	00992	联想集团	52,000	380,936.20	0.29
76	600271	航天信息	28,300	378,937.00	0.29
77	600201	生物股份	23,100	377,685.00	0.29
78	601766	中国中车	59,600	362,964.00	0.28
79	02319	蒙牛乳业	10,000	361,379.20	0.28
80	600795	国电电力	113,400	359,478.00	0.28
81	600362	江西铜业	16,000	357,280.00	0.27
82	002230	科大讯飞	6,800	357,068.00	0.27
83	600170	上海建工	97,800	352,080.00	0.27

84	600057	厦门象屿	41,100	348,939.00	0.27
85	002697	红旗连锁	65,400	347,928.00	0.27
86	601607	上海医药	17,500	347,725.00	0.27
87	688981	中芯国际	6,546	346,872.54	0.27
88	000651	格力电器	9,300	344,379.00	0.26
89	601006	大秦铁路	53,300	341,120.00	0.26
89	603708	家家悦	20,500	341,120.00	0.26
91	002352	顺丰控股	4,900	337,708.00	0.26
92	000069	华侨城 A	47,800	336,512.00	0.26
93	601288	农业银行	113,100	332,514.00	0.25
94	601816	京沪高铁	68,500	330,855.00	0.25
95	03320	华润医药	113,500	329,431.48	0.25
96	601988	中国银行	106,800	325,740.00	0.25
97	600346	恒力石化	14,100	323,877.00	0.25
98	01093	石药集团	46,000	318,553.31	0.24
99	000100	TCL 科技	50,200	309,734.00	0.24
100	601728	中国电信	70,900	306,997.00	0.24
101	600010	包钢股份	108,600	302,994.00	0.23
102	600031	三一重工	12,900	294,120.00	0.23
103	300750	宁德时代	500	294,000.00	0.23
104	002416	爱施德	25,800	293,604.00	0.23
105	601688	华泰证券	16,500	293,040.00	0.22
106	600276	恒瑞医药	5,764	292,292.44	0.22
107	01177	中国生物制药	64,000	285,702.14	0.22
108	01810	小米集团-W	18,400	284,328.58	0.22
109	601211	国泰君安	15,600	279,084.00	0.21
110	600195	中牧股份	21,300	278,391.00	0.21
111	600808	马钢股份	74,600	275,274.00	0.21
112	002493	荣盛石化	15,150	275,124.00	0.21
113	00267	中信股份	43,000	270,707.36	0.21
114	600332	白云山	7,800	266,760.00	0.20
115	000898	鞍钢股份	70,800	265,500.00	0.20
116	600598	北大荒	18,000	262,080.00	0.20
117	00175	吉利汽车	15,000	261,223.20	0.20
118	600741	华域汽车	9,200	260,360.00	0.20
119	601155	新城控股	8,900	259,257.00	0.20
120	000825	太钢不锈	36,800	259,072.00	0.20
121	000063	中兴通讯	7,700	257,950.00	0.20
122	03396	联想控股	27,100	255,248.17	0.20
123	002092	中泰化学	26,700	254,718.00	0.20
124	002458	益生股份	22,100	249,951.00	0.19
125	600690	海尔智家	8,300	248,087.00	0.19
126	000039	中集集团	14,100	241,956.00	0.19
127	02688	新奥能源	2,000	240,047.36	0.18

128	601012	隆基股份	2,740	236,188.00	0.18
129	09633	农夫山泉	5,600	235,566.91	0.18
130	600299	安迪苏	18,200	224,224.00	0.17
131	002410	广联达	3,500	223,930.00	0.17
132	600297	广汇汽车	82,600	220,542.00	0.17
133	600196	复星医药	4,500	220,230.00	0.17
134	600027	华电国际	40,700	217,745.00	0.17
135	600352	浙江龙盛	17,200	217,236.00	0.17
136	002746	仙坛股份	20,700	217,143.00	0.17
137	000703	恒逸石化	20,350	216,117.00	0.17
138	600089	特变电工	10,200	215,934.00	0.17
139	01378	中国宏桥	32,000	215,323.13	0.17
140	601952	苏垦农发	18,000	214,380.00	0.16
141	601658	邮储银行	41,900	213,690.00	0.16
142	600588	用友网络	5,900	211,692.00	0.16
143	600814	杭州解百	32,300	210,919.00	0.16
144	601233	桐昆股份	9,900	209,682.00	0.16
145	02331	李宁	3,000	209,346.48	0.16
146	002234	民和股份	11,900	204,204.00	0.16
147	600584	长电科技	6,500	201,630.00	0.15
148	003816	中国广核	64,200	200,946.00	0.15
149	600570	恒生电子	3,200	198,880.00	0.15
150	300383	光环新网	13,100	194,404.00	0.15
151	601992	金隅集团	68,200	193,688.00	0.15
152	002661	克明食品	16,300	192,992.00	0.15
153	601985	中国核电	23,200	192,560.00	0.15
154	00489	东风集团股份	36,000	190,729.73	0.15
155	600177	雅戈尔	27,500	189,475.00	0.15
156	600710	苏美达	28,700	187,698.00	0.14
157	000630	铜陵有色	53,100	184,788.00	0.14
158	600108	亚盛集团	52,200	184,266.00	0.14
159	00322	康师傅控股	14,000	183,371.32	0.14
160	600886	国投电力	15,700	180,079.00	0.14
161	000625	长安汽车	11,800	179,242.00	0.14
162	000488	晨鸣纸业	24,700	178,828.00	0.14
163	000538	云南白药	1,700	177,905.00	0.14
164	000877	天山股份	11,600	177,596.00	0.14
165	002475	立讯精密	3,590	176,628.00	0.14
166	002422	科伦药业	9,200	174,156.00	0.13
167	000735	罗牛山	24,000	171,120.00	0.13
168	00836	华润电力	8,000	170,714.88	0.13
169	002373	千方科技	11,300	168,935.00	0.13
170	000963	华东医药	4,200	168,840.00	0.13
171	600958	东方证券	11,400	168,036.00	0.13

172	600655	豫园股份	16,300	167,890.00	0.13
173	002091	江苏国泰	12,200	167,506.00	0.13
174	00135	昆仑能源	28,000	167,346.37	0.13
175	000776	广发证券	6,800	167,212.00	0.13
176	601168	西部矿业	12,000	163,320.00	0.13
177	600219	南山铝业	34,000	160,140.00	0.12
178	02313	申洲国际	1,300	159,325.72	0.12
179	00576	浙江沪杭甬	28,000	159,104.96	0.12
180	600999	招商证券	8,910	157,261.50	0.12
181	002415	海康威视	3,000	156,960.00	0.12
182	603501	韦尔股份	500	155,385.00	0.12
183	02020	安踏体育	1,600	152,923.90	0.12
184	600754	锦江酒店	2,600	152,360.00	0.12
185	300760	迈瑞医疗	400	152,320.00	0.12
186	000157	中联重科	21,200	152,004.00	0.12
187	02269	药明生物	2,000	151,337.76	0.12
188	002202	金风科技	9,000	148,230.00	0.11
189	00656	复星国际	21,500	147,834.34	0.11
190	002065	东华软件	18,900	147,420.00	0.11
191	600426	华鲁恒升	4,680	146,484.00	0.11
192	688162	巨一科技	1,758	145,122.90	0.11
193	01193	华润燃气	4,000	144,061.12	0.11
194	600739	辽宁成大	7,300	142,496.00	0.11
195	000895	双汇发展	4,500	141,975.00	0.11
196	600097	开创国际	12,300	141,696.00	0.11
197	603613	国联股份	1,300	139,750.00	0.11
198	603993	洛阳钼业	24,900	138,942.00	0.11
199	002001	新和成	4,460	138,795.20	0.11
200	600998	九州通	9,400	138,368.00	0.11
201	000166	申万宏源	26,800	137,216.00	0.11
202	300122	智飞生物	1,100	137,060.00	0.11
203	00780	同程旅行	11,600	136,951.27	0.11
204	300773	拉卡拉	4,700	136,394.00	0.10
205	600251	冠农股份	14,300	135,135.00	0.10
206	600079	人福医药	6,000	135,120.00	0.10
207	601866	中远海发	41,200	133,900.00	0.10
208	00392	北京控股	6,000	131,960.64	0.10
209	002304	洋河股份	800	131,784.00	0.10
210	000830	鲁西化工	8,600	131,236.00	0.10
211	600380	健康元	10,200	130,968.00	0.10
212	000708	中信特钢	6,350	130,048.00	0.10
213	002183	怡亚通	19,300	127,766.00	0.10
214	600500	中化国际	14,860	127,201.60	0.10
215	000568	泸州老窖	500	126,935.00	0.10

216	00881	中升控股	2,500	124,275.20	0.10
217	00148	建滔集团	4,000	124,111.68	0.10
218	02689	玖龙纸业	18,000	123,179.62	0.09
219	000425	徐工机械	20,500	122,795.00	0.09
220	00152	深圳国际	18,500	122,517.36	0.09
221	601991	大唐发电	37,800	122,472.00	0.09
222	600845	宝信软件	2,000	121,660.00	0.09
223	000878	云南铜业	8,900	118,993.00	0.09
224	600467	好当家	41,500	118,275.00	0.09
225	000959	首钢股份	20,600	118,038.00	0.09
226	00696	中国民航信息网络	11,000	117,996.03	0.09
227	603858	步长制药	5,540	116,838.60	0.09
228	00144	招商局港口	10,000	116,099.20	0.09
229	600535	天士力	7,300	115,705.00	0.09
230	300033	同花顺	800	115,664.00	0.09
231	000906	浙商中拓	10,400	115,544.00	0.09
232	01044	恒安国际	3,500	114,893.24	0.09
233	300271	华宇软件	9,000	114,300.00	0.09
234	600127	金健米业	13,500	114,210.00	0.09
235	00384	中国燃气	8,600	113,908.03	0.09
236	600438	通威股份	2,500	112,400.00	0.09
237	002688	金河生物	18,300	112,179.00	0.09
238	002649	博彦科技	9,600	112,128.00	0.09
239	02314	理文造纸	25,000	110,784.80	0.08
240	000911	南宁糖业	10,300	110,210.00	0.08
241	00570	中国中药	26,000	109,901.79	0.08
242	600258	首旅酒店	4,200	109,746.00	0.08
243	000807	云铝股份	9,800	109,466.00	0.08
244	600850	电科数字	3,200	109,216.00	0.08
245	000513	丽珠集团	2,700	108,567.00	0.08
246	603566	普莱柯	4,900	108,290.00	0.08
247	600085	同仁堂	2,400	107,952.00	0.08
248	600893	航发动力	1,700	107,882.00	0.08
249	000713	丰乐种业	11,000	106,700.00	0.08
250	000999	华润三九	3,100	106,144.00	0.08
251	002004	华邦健康	14,500	104,980.00	0.08
252	00291	华润啤酒	2,000	104,407.52	0.08
253	300677	英科医疗	1,800	104,112.00	0.08
254	03808	中国重汽	10,500	103,017.60	0.08
255	600166	福田汽车	29,800	102,512.00	0.08
256	002368	太极股份	3,700	101,898.00	0.08
257	601718	际华集团	33,700	100,426.00	0.08
258	002185	华天科技	7,900	100,409.00	0.08

259	000555	神州信息	7,800	99,216.00	0.08
260	600096	云天化	5,000	98,100.00	0.08
261	000960	锡业股份	5,000	97,650.00	0.07
262	601877	正泰电器	1,800	97,002.00	0.07
263	600728	佳都科技	11,600	96,628.00	0.07
264	600612	老凤祥	2,100	96,285.00	0.07
265	00867	康哲药业	9,000	95,806.37	0.07
266	002078	太阳纸业	8,300	95,367.00	0.07
267	603225	新凤鸣	6,400	95,040.00	0.07
268	601598	中国外运	21,200	94,976.00	0.07
269	300012	华测检测	3,500	94,045.00	0.07
270	01530	三生制药	17,500	93,002.00	0.07
271	601138	工业富联	7,800	92,976.00	0.07
272	300166	东方国信	8,600	92,880.00	0.07
273	600406	国电南瑞	2,260	90,467.80	0.07
274	600398	海澜之家	13,900	89,099.00	0.07
275	01199	中远海运港口	16,000	88,562.43	0.07
276	603986	兆易创新	500	87,925.00	0.07
277	601633	长城汽车	1,800	87,372.00	0.07
278	600801	华新水泥	4,500	86,850.00	0.07
279	01313	华润水泥控股	18,000	86,681.95	0.07
280	600489	中金黄金	10,500	86,415.00	0.07
281	600023	浙能电力	21,300	86,052.00	0.07
282	688111	金山办公	324	85,860.00	0.07
283	688121	卓然股份	2,331	84,895.02	0.07
284	601628	中国人寿	2,800	84,252.00	0.06
285	600026	中远海能	14,200	84,064.00	0.06
286	300253	卫宁健康	5,000	83,800.00	0.06
287	02357	中航科工	19,000	83,730.42	0.06
288	002129	中环股份	2,000	83,500.00	0.06
289	600567	山鹰国际	25,000	82,250.00	0.06
290	603927	中科软	3,000	82,080.00	0.06
291	03898	时代电气	2,200	81,212.21	0.06
292	000060	中金岭南	16,400	80,524.00	0.06
293	600497	驰宏锌锗	16,100	80,339.00	0.06
294	600989	宝丰能源	4,600	79,856.00	0.06
295	01066	威高股份	10,000	79,552.48	0.06
296	600420	国药现代	7,600	78,812.00	0.06
297	600839	四川长虹	23,700	78,447.00	0.06
298	002736	国信证券	6,800	78,064.00	0.06
299	600522	中天科技	4,600	78,016.00	0.06
300	600018	上港集团	14,233	77,996.84	0.06
301	002408	齐翔腾达	7,400	77,700.00	0.06
302	000683	远兴能源	10,600	77,380.00	0.06

303	601872	招商轮船	18,800	77,080.00	0.06
304	300003	乐普医疗	3,400	76,942.00	0.06
305	600409	三友化工	8,800	76,560.00	0.06
306	600058	五矿发展	8,200	76,014.00	0.06
307	601828	美凯龙	8,500	74,885.00	0.06
308	002041	登海种业	2,900	74,791.00	0.06
309	002421	达实智能	19,200	74,112.00	0.06
310	01208	五矿资源	36,000	73,584.00	0.06
311	601216	君正集团	13,800	72,174.00	0.06
312	06862	海底捞	5,000	71,948.80	0.06
313	03933	联邦制药	20,000	71,294.72	0.05
314	01347	华虹半导体	2,000	70,313.60	0.05
315	000028	国药一致	1,900	70,262.00	0.05
316	002120	韵达股份	3,430	70,177.80	0.05
317	600233	圆通速递	4,200	70,056.00	0.05
318	600066	宇通客车	6,300	69,426.00	0.05
319	01308	海丰国际	3,000	69,168.96	0.05
320	002042	华孚时尚	15,100	69,007.00	0.05
321	000652	泰达股份	15,900	68,529.00	0.05
322	02186	绿叶制药	23,500	68,400.42	0.05
323	600062	华润双鹤	5,100	68,187.00	0.05
324	600415	小商品城	13,900	67,415.00	0.05
325	01333	中国忠旺	48,800	67,030.12	0.05
326	00354	中国软件国际	8,000	66,454.53	0.05
327	06618	京东健康	1,300	65,313.98	0.05
328	603160	汇顶科技	600	64,662.00	0.05
329	603899	晨光文具	1,000	64,510.00	0.05
330	600111	北方稀土	1,400	64,120.00	0.05
331	002156	通富微电	3,300	64,119.00	0.05
332	601881	中国银河	5,700	63,783.00	0.05
333	600549	厦门钨业	2,800	63,364.00	0.05
334	000626	远大控股	2,500	62,150.00	0.05
335	000035	中国天楹	10,300	61,903.00	0.05
336	300369	绿盟科技	3,900	61,854.00	0.05
337	001201	东瑞股份	1,600	61,728.00	0.05
338	600521	华海药业	2,800	60,648.00	0.05
339	600623	华谊集团	6,600	60,060.00	0.05
340	601989	中国重工	14,200	59,924.00	0.05
341	600566	济川药业	2,100	59,514.00	0.05
342	002008	大族激光	1,100	59,400.00	0.05
343	002013	中航机电	3,260	59,266.80	0.05
344	600717	天津港	14,100	59,079.00	0.05
345	00268	金蝶国际	3,000	58,867.20	0.05
346	300274	阳光电源	400	58,320.00	0.04

347	300015	爱尔眼科	1,378	58,261.84	0.04
348	00512	远大医药	11,000	58,098.66	0.04
349	002603	以岭药业	2,900	56,840.00	0.04
350	600511	国药股份	1,800	56,754.00	0.04
351	00861	神州控股	14,000	56,659.68	0.04
352	300999	金龙鱼	900	56,637.00	0.04
353	002556	辉隆股份	4,400	56,628.00	0.04
354	00552	中国通信服务	18,000	55,923.84	0.04
355	600446	金证股份	3,900	55,848.00	0.04
356	600056	中国医药	4,700	55,507.00	0.04
357	300496	中科创达	400	55,368.00	0.04
358	002064	华峰化学	5,300	55,332.00	0.04
359	600787	中储股份	8,700	54,288.00	0.04
360	000938	紫光股份	2,360	53,926.00	0.04
361	600879	航天电子	6,500	53,560.00	0.04
362	300433	蓝思科技	2,300	52,854.00	0.04
363	600812	华北制药	4,400	52,448.00	0.04
364	300505	川金诺	1,700	52,088.00	0.04
365	002340	格林美	5,000	51,750.00	0.04
366	300188	美亚柏科	3,000	51,570.00	0.04
367	002203	海亮股份	4,100	50,963.00	0.04
368	000528	柳工	6,600	50,886.00	0.04
369	002010	传化智联	5,800	50,460.00	0.04
370	603939	益丰药房	900	49,599.00	0.04
371	601615	明阳智能	1,900	49,590.00	0.04
372	600308	华泰股份	7,900	48,901.00	0.04
373	600418	江淮汽车	2,800	48,720.00	0.04
374	000800	一汽解放	4,700	48,363.00	0.04
375	000553	安道麦 A	5,700	48,108.00	0.04
376	600760	中航沈飞	700	47,628.00	0.04
377	600528	中铁工业	5,700	46,797.00	0.04
378	688526	科前生物	1,685	46,388.05	0.04
379	300207	欣旺达	1,100	46,376.00	0.04
380	002301	齐心集团	5,500	46,035.00	0.04
381	002153	石基信息	1,600	45,984.00	0.04
382	600803	新奥股份	2,500	45,900.00	0.04
383	601880	辽港股份	26,500	45,845.00	0.04
384	601319	中国人保	9,600	45,120.00	0.03
385	002049	紫光国微	200	45,000.00	0.03
386	600150	中国船舶	1,800	44,622.00	0.03
387	000301	东方盛虹	2,300	44,482.00	0.03
388	600966	博汇纸业	4,300	44,462.00	0.03
389	000921	海信家电	2,900	43,935.00	0.03
390	603883	老百姓	880	43,454.40	0.03

391	000009	中国宝安	3,000	43,290.00	0.03
392	601018	宁波港	10,800	42,876.00	0.03
393	002701	奥瑞金	6,100	42,700.00	0.03
394	300070	碧水源	5,900	42,421.00	0.03
395	002441	众业达	4,100	41,820.00	0.03
396	603718	海利生物	2,700	41,310.00	0.03
397	688009	中国通号	8,271	41,189.58	0.03
398	300124	汇川技术	600	41,160.00	0.03
399	300184	力源信息	5,900	40,946.00	0.03
400	600582	天地科技	9,300	40,734.00	0.03
401	002179	中航光电	400	40,224.00	0.03
402	601066	中信建投	1,300	38,025.00	0.03
403	01675	亚信科技	3,600	37,439.54	0.03
404	600885	宏发股份	500	37,320.00	0.03
405	600967	内蒙一机	3,100	37,045.00	0.03
406	300682	朗新科技	1,000	37,030.00	0.03
407	600320	振华重工	9,800	36,946.00	0.03
408	000951	中国重汽	2,180	36,820.20	0.03
409	000550	江铃汽车	2,200	35,882.00	0.03
410	300676	华大基因	400	35,120.00	0.03
411	002371	北方华创	100	34,702.00	0.03
412	000061	农产品	5,200	33,228.00	0.03
413	605296	神农集团	800	32,248.00	0.02
414	600025	华能水电	4,800	31,632.00	0.02
415	000950	重药控股	6,200	31,620.00	0.02
416	03331	维达国际	2,000	31,068.80	0.02
416	03692	翰森制药	2,000	31,068.80	0.02
418	600540	新赛股份	5,100	30,651.00	0.02
419	002831	裕同科技	900	30,321.00	0.02
420	02618	京东物流	1,400	30,275.73	0.02
421	600312	平高电气	3,300	29,997.00	0.02
422	600482	中国动力	1,500	29,550.00	0.02
423	600884	杉杉股份	900	29,493.00	0.02
424	300970	华绿生物	1,000	29,170.00	0.02
425	000049	德赛电池	500	29,160.00	0.02
426	600372	中航电子	1,300	29,107.00	0.02
427	603233	大参林	688	28,971.68	0.02
428	300871	回盛生物	1,000	28,480.00	0.02
429	600359	新农开发	3,400	28,458.00	0.02
430	600350	山东高速	5,500	28,380.00	0.02
431	600315	上海家化	700	28,287.00	0.02
432	603336	宏辉果蔬	3,600	28,116.00	0.02
433	600377	宁沪高速	3,200	27,584.00	0.02
434	600323	瀚蓝环境	1,300	27,274.00	0.02

435	00819	天能动力	4,000	26,980.80	0.02
436	600548	深高速	2,700	26,946.00	0.02
437	300967	晓鸣股份	1,000	26,660.00	0.02
438	01070	T C L 电子	8,000	26,490.24	0.02
439	600869	远东股份	3,800	26,144.00	0.02
440	000400	许继电气	1,000	26,100.00	0.02
441	600580	卧龙电驱	1,400	25,606.00	0.02
442	601298	青岛港	4,500	25,605.00	0.02
443	600835	上海机电	1,600	25,472.00	0.02
444	02678	天虹纺织	3,000	25,263.84	0.02
445	002812	恩捷股份	100	25,040.00	0.02
446	600973	宝胜股份	4,200	24,906.00	0.02
447	002028	思源电气	500	24,605.00	0.02
448	601100	恒立液压	300	24,540.00	0.02
449	601995	中金公司	500	24,515.00	0.02
450	601965	中国汽研	1,300	24,193.00	0.02
451	300014	亿纬锂能	200	23,636.00	0.02
452	601179	中国西电	4,100	22,755.00	0.02
453	000062	深圳华强	1,300	22,399.00	0.02
454	000019	深粮控股	3,200	22,272.00	0.02
455	002117	东港股份	2,600	21,658.00	0.02
456	00968	信义光能	2,000	21,617.34	0.02
457	688396	华润微	334	21,576.40	0.02
458	601311	骆驼股份	1,400	21,462.00	0.02
459	600875	东方电气	1,000	21,420.00	0.02
460	601567	三星医疗	1,300	21,203.00	0.02
461	603588	高能环境	1,200	21,084.00	0.02
462	300053	欧比特	2,000	20,340.00	0.02
463	601200	上海环境	1,600	20,144.00	0.02
464	00189	东岳集团	2,000	19,884.03	0.02
465	600662	外服控股	2,700	19,332.00	0.01
466	600916	中国黄金	1,400	19,222.00	0.01
467	300662	科锐国际	300	18,663.00	0.01
468	00363	上海实业控股	2,000	18,575.87	0.01
469	002459	晶澳科技	200	18,540.00	0.01
470	002599	盛通股份	2,400	18,360.00	0.01
471	300979	华利集团	200	17,810.00	0.01
472	01882	海天国际	1,000	17,701.04	0.01
473	300215	电科院	1,700	17,051.00	0.01
474	601106	中国一重	4,800	16,704.00	0.01
475	603659	璞泰来	100	16,061.00	0.01
476	03998	波司登	4,000	16,057.66	0.01
477	00586	海螺创业	500	15,575.28	0.01
478	002717	岭南股份	4,300	14,835.00	0.01

479	00909	明源云	1,000	14,520.58	0.01
480	002672	东江环保	1,900	13,984.00	0.01
481	002532	天山铝业	1,700	13,855.00	0.01
482	601568	北元集团	1,700	13,821.00	0.01
483	01818	招金矿业	2,500	13,613.04	0.01
484	300416	苏试试验	400	13,580.00	0.01
485	688599	天合光能	164	12,939.60	0.01
486	300388	节能国祯	1,600	12,560.00	0.01
487	000798	中水渔业	1,600	12,352.00	0.01
488	002479	富春环保	2,000	11,880.00	0.01
489	002999	天禾股份	1,700	11,679.00	0.01
490	002573	清新环境	1,600	11,648.00	0.01
491	601865	福莱特	200	11,588.00	0.01
492	603060	国检集团	600	11,580.00	0.01
493	601388	怡球资源	2,600	11,570.00	0.01
494	002453	华软科技	600	10,884.00	0.01
495	002034	旺能环境	600	10,362.00	0.01
496	00257	光大环境	2,000	10,236.35	0.01
497	601827	三峰环境	1,100	9,812.00	0.01
498	002534	杭锅股份	300	9,507.00	0.01
499	600475	华光环能	800	9,472.00	0.01
500	000058	深赛格	1,400	9,422.00	0.01
501	301039	中集车辆	700	8,981.00	0.01
502	600517	国网英大	1,100	8,019.00	0.01
503	300493	润欣科技	1,000	7,980.00	0.01
504	600292	远达环保	900	7,686.00	0.01
505	603568	伟明环保	200	7,306.00	0.01
506	03339	中国龙工	4,000	7,162.18	0.01
507	300887	谱尼测试	100	6,770.00	0.01
508	002266	浙富控股	900	6,408.00	0.00
509	06993	蓝月亮集团	1,000	6,050.24	0.00
510	601028	玉龙股份	300	5,712.00	0.00
511	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
512	300797	钢研纳克	300	5,262.00	0.00
513	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
514	00658	中国高速传动	1,000	4,594.91	0.00
515	603933	睿能科技	300	4,554.00	0.00
516	003035	南网能源	500	4,145.00	0.00
517	300902	国安达	100	4,121.00	0.00
518	300962	中金辐照	200	3,966.00	0.00
519	002819	东方中科	100	3,326.00	0.00
520	300688	创业黑马	100	3,267.00	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	19,147,329.73	17.99
2	03690	美团-W	5,321,223.27	5.00
3	601939	建设银行	4,617,894.88	4.34
4	03323	中国建材	3,582,043.42	3.36
5	601888	中国中免	3,547,237.00	3.33
6	600905	三峡能源	3,436,527.95	3.23
7	601668	中国建筑	3,244,005.00	3.05
8	600887	伊利股份	3,038,950.00	2.85
9	600519	贵州茅台	3,018,210.00	2.84
10	601318	中国平安	2,959,274.00	2.78
11	000002	万科 A	2,933,610.62	2.76
12	601390	中国中铁	2,409,570.00	2.26
13	600028	中国石化	2,273,541.00	2.14
14	000829	天音控股	2,139,533.00	2.01
15	601186	中国铁建	2,124,926.00	2.00
16	300498	温氏股份	1,886,453.86	1.77
17	600827	百联股份	1,879,063.00	1.77
18	002311	海大集团	1,858,624.00	1.75
19	000858	五粮液	1,768,485.00	1.66
20	002385	大北农	1,735,005.00	1.63

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。

8.4.2 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	00700	腾讯控股	11,815,381.92	11.10
2	600905	三峡能源	7,887,941.29	7.41
3	03690	美团-W	4,886,433.43	4.59
4	600887	伊利股份	4,447,715.00	4.18
5	600519	贵州茅台	4,284,711.00	4.02
6	03323	中国建材	3,940,125.83	3.70
7	000829	天音控股	3,545,848.60	3.33
8	601939	建设银行	3,450,692.00	3.24
9	300498	温氏股份	3,050,534.05	2.87
10	00267	中信股份	2,745,050.75	2.58
11	600655	豫园股份	2,516,396.00	2.36

12	601668	中国建筑	2,337,926.00	2.20
13	02319	蒙牛乳业	2,333,767.50	2.19
14	000858	五粮液	2,163,271.52	2.03
15	000002	万科 A	2,122,016.00	1.99
16	601318	中国平安	2,058,732.00	1.93
17	601888	中国中免	2,057,804.00	1.93
18	601669	中国电建	1,912,216.00	1.80
19	601390	中国中铁	1,779,827.00	1.67
20	000338	潍柴动力	1,666,408.00	1.57

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。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	228,416,298.48
卖出股票收入（成交）总额	209,505,354.86

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。

8.5 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）	5,600.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,600.00	0.00

8.6 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	123132	回盛转债	51	5,100.00	0.00
2	127052	杭锅转债	5	500.00	0.00
3	-	-	-	-	-

4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，美团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，美团一W系标的指数成份股，上述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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	66,179.50
2	应收证券清算款	72,522.16
3	应收股利	17,477.40
4	应收利息	2,889.88

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,068.94

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

9 基金份额持有人信息

9.1 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	1,994	20,507.42	24,539,427.85	60.01%	16,352,373.24	39.99%
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	18,131	3,028.04	8,806,554.91	16.04%	46,094,776.77	83.96%
合计	20,125	4,759.91	33,345,982.76	34.81%	62,447,150.01	65.19%

9.2 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	407,531.39	1.00%
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	54,411.63	0.10%
	合计	461,943.02	0.48%

9.3 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、基金投资和研发部门负责人	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	10~50

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

9.4 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	10.44%	10,000,000.00	10.44%	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	10.44%	10,000,000.00	10.44%	不少于三年

§10 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	89,443,739.47	93,696,666.32
减：本报告期基金总赎回份额	76,215,036.54	94,383,233.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,891,801.09	54,901,331.68

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

本基金管理人于 2021 年 11 月 2 日发布公告，蔡向阳先生不再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。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 3 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	10	295,455,549.91	68.52%	133,513.01	69.22%	-
东方证券	1	89,440,757.66	20.74%	39,047.44	20.24%	-
西部证券	1	18,708,678.61	4.34%	8,189.94	4.25%	-
华泰证券	1	14,374,529.66	3.33%	6,601.95	3.42%	-
方正证券	2	7,559,114.30	1.75%	3,383.47	1.75%	-
广发证券	2	4,258,676.23	0.99%	1,952.79	1.01%	-
国泰君安证券	2	1,368,649.09	0.32%	205.33	0.11%	-

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，本基金还选择了长江证券、高华证券、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，长江证券、中金公司、中信证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元，中信证券的部分交易单元为本期剔除的交易单元。

11.7.2 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	292,848.58	73.39%	-	-
东方证券	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-
方正证券	106,197.70	26.61%	-	-
广发证券	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-

11.8 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	中国证监会指定报刊及	2021-01-15

	关联方承销证券的公告	网站	
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
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	2021-08-05

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	2021-08-07
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	2021-08-14
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	2021-10-13
28	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	2021-10-15
29	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	2021-10-22
30	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	2021-10-23
31	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-02
32	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	2021-11-22
33	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金暂停申购、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	2021-12-24

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

二〇二二年三月三十日