

---

**华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金**  
**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：中国银行股份有限公司

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 4 月 7 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.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 审计报告.....	13
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告.....	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
8.12 投资组合报告附注.....	58
§9 基金份额持有人信息.....	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
9.4 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情况.....	59
§10 开放式基金份额变动.....	60
§11 重大事件揭示.....	60
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§13 备查文件目录.....	64

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证沪港深 500ETF
场内简称	沪港深 E (扩位简称: 沪港深 ETF)
基金主代码	517170
交易代码	517170
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 4 月 7 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	51,131,846.00 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
上市日期	2021 年 4 月 20 日

### 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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%, 年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括完全复制策略, 替代性策略, 存托凭证投资策略, 衍生品投资策略, 债券投资策略, 资产支持证券投资策略, 融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
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。 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	010-66596688
	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	《中国证券报》
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	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

## §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 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	568,575.98
本期利润	-3,039,710.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0432
本期加权平均净值利润率	-4.43%
本期基金份额净值增长率	-7.39%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	-3,777,521.74
期末可供分配基金份额利润	-0.0739
期末基金资产净值	47,354,324.26
期末基金份额净值	0.9261
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-7.39%

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。

④本基金合同于 2021 年 4 月 7 日生效。

### 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
过去三个月	-1.10%	0.74%	-1.16%	0.76%	0.06%	-0.02%
过去六个月	-9.15%	1.03%	-10.95%	1.06%	1.80%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-7.39%	0.95%	-10.61%	1.00%	3.22%	-0.05%

#### 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

华夏中证沪港深 500 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的历史走势对比图  
 (2021 年 4 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日)

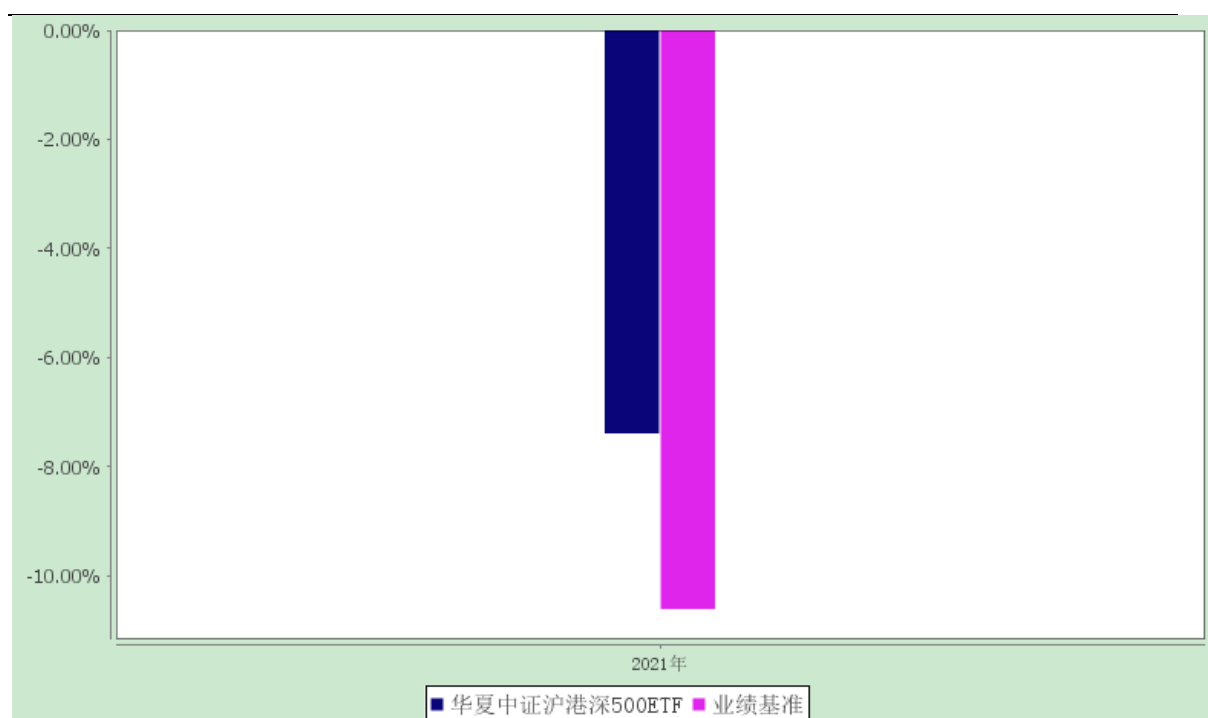


注：①本基金合同于 2021 年 4 月 7 日生效。

②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

#### 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

华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金  
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2021 年 4 月 7 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		
徐猛	本基金的基金经理、投委会成员	2021-04-07	-	18 年	硕士。曾任财富证券助理研究员，原中关村证券研究员等。2006 年 2 月加入华夏基金管理有限公司。曾任数量投资部基金经理助理、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2016 年 1 月 29 日至 2016 年 3 月 28 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 3 月 12 日至 2021 年 2 月 1 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015 年 3 月 12 日至 2021 年 2 月 1 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。

#### 4.1.3 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中证沪港深 500 指数（指数代码：H30455，指数简称：沪港深 500）发布于 2014 年 11 月 28 日，该指数选取沪港深交易所上市的互联互通范围内上市公司证券作为指数样本，以全面反映沪港深三地上市企业证券的整体表现。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。

2021 年，国际方面，疫情依然没有结束，部分国家出现了变种病毒，与此同时，通胀持续超出预期，美国 12 月 CPI 同比增长 7%，创下近 40 年来新高。面对持续高企的通胀，至少在当前时点下，高通胀已成为美联储的“头号敌人”，通过加速 Taper 并改变对通胀的立场，美联储试图为提前加息提供空间。而受困于高通胀，英国央行已先于美联储加息，在此之前，俄罗斯、巴西、土耳其乃至韩国等国已经率先加息。国内方面，疫情虽有反复，但已基本控制，整体经济韧性较强。出口持续超预期，但在供给冲击、需求收缩、预期转弱的三重压力下，经济短期面临较大压力。中央经济工作会议强调经济要稳字当头、稳中求进。这也成为现阶段货币政策、财政政策的主基调。

市场方面，鉴于全年经济恢复一波三折、通胀数据居高不下、货币政策顾虑重重，这种艰难与纠结下，2021 年市场整体呈震荡走势。

年初市场延续之前的乐观情绪一路上攻，但在农历年后，随着十年期美债收益率超预期上涨、拜登政府经济刺激方案出台，市场对于通胀的预期、对于未来可能的宽松政策退出的担忧明显加剧，市场经历了一波较深幅度的调整；随后美联储表态通胀压力是暂时的，并继续维持宽松的货币政策，风险偏好逐渐抬升，市场重拾上涨；但国内经济类滞涨与信用收缩的担忧终究抑制了市场情绪，在个别地产公司债务问题发酵、限电限产一刀切担忧等因素影响下，市场风险偏好再次走弱，虽然国内政策逐渐走向宽松，但随着美国通胀持续创下历史新高并成为美联储不得不重视的头等风险后，对市场情绪也形成较大抑制。纵观全年，市场整体呈震荡格局，但资产荒依然是当下的重要特征，在一些较为确定的板块，仍然会阶段性地出现结构性投资机会。

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、赎回和成份股调整等工作。

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中泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.9261 元，本报告期份额净值增长率为-7.39%，同期经估值汇率调整的业绩比较基准增长率-10.61%。本基金本报告期跟踪偏离度为+3.22%，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 2022 年，世界范围内，疫情下的经济恢复、通胀、债务状况，以及相应的政策抉择，是未来需要重点关注的因素。就中短期而言，海外流动性收敛是较为明确的主线。

国内方面，就短期而言，政策依然是边际放松，全年预计是稳中有进。

所谓稳主要是由于经济增长的压力依然较大，投资、消费后继乏力，至少在上半年，财政、产业等稳增长政策将密集出台。而从更长时间的视角看，我国当下处于经济转型的关键期，从国际上看，当前时点又处于重要的战略机遇期，因此，稳增长在举措与节奏上是需要密切关注的。

所谓进，则是我们的政策在考虑短期的稳之外，更需要关注的是我们长期的空间与动力，我们的人口问题、我们在世界经济分工中的定位问题、我们经济的持续发展动能问题，而这些则需要我们主动打破而不是哪怕被动地强化既有的沉疴旧疾，依靠科技创新，为经济长远发展提供长久的内生动力。

就市场而言，如果经济能够维持稳定或政府出台超预期的改革或提振市场的政策，市场或有较好的表现。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥 ETF 的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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人员的职责，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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 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

本基金自 2021 年 6 月 18 日至 2021 年 9 月 7 日出现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”）在华夏中证沪港深 500 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 审计报告

普华永道中天审字（2022）第 24753 号

华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏中证沪港深 500ETF”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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沪港深 500ETF2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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沪港深 500ETF，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

华夏中证沪港深 500ETF 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沪港深 500ETF 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沪港深 500ETF、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沪港深 500ETF 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，就可能对华夏中证沪港深 500ETF 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沪港深 500ETF 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：华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

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
资产：		
银行存款	7.4.7.1	1,561,320.14
结算备付金		1,565,913.23
存出保证金		17,632.25
交易性金融资产	7.4.7.2	46,175,983.86
其中：股票投资		46,175,983.86
基金投资		-
债券投资		-
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		80,149.63
应收利息	7.4.7.5	319.02
应收股利		3,295.20
应收申购款		-



递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		49,404,613.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 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		4.20
应付赎回款		-
应付管理人报酬		21,983.22
应付托管费		4,396.66
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	4,437.33
应交税费		3.03
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	2,019,464.63
负债合计		2,050,289.07
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	51,131,846.00
未分配利润	7.4.7.10	-3,777,521.74
所有者权益合计		47,354,324.26
负债和所有者权益总计		49,404,613.33

注：①报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9261 元，基金份额总额 51,131,846.00 份。

②本基金合同于 2021 年 4 月 7 日生效，本报告期自 2021 年 4 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		-1,982,647.36
1.利息收入		58,318.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	58,318.02

债券利息收入		0.03
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）		1,284,575.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	387,696.43
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	104.57
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	90.33
股利收益	7.4.7.16	896,684.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,608,286.22
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	282,745.27
减：二、费用		1,057,062.88
1. 管理人报酬		247,708.34
2. 托管费		49,541.71
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	613,150.19
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.32
7. 其他费用	7.4.7.20	146,662.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,039,710.24
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,039,710.24

注：本基金合同于 2021 年 4 月 7 日生效，本报告期自 2021 年 4 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 4 月 7 日（基金合同生效日）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）	301,131,846.00	-	301,131,846.00

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,039,710.24	-3,039,710.24
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）	-250,000,000.00	-737,811.50	-250,737,811.50
其中：1.基金申购款	20,000,000.00	-673,014.21	19,326,985.79
2.基金赎回款	-270,000,000.00	-64,797.29	-270,064,797.29
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）	51,131,846.00	-3,777,521.74	47,354,324.26

注：本基金合同于 2021 年 4 月 7 日生效，本报告期自 2021 年 4 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日。

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

华夏中证沪港深 500 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[2020]3529 号《关于准予华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证沪港深 500 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。本基金于 2021 年 3 月 29 日至 2021 年 3 月 31 日募集 301,129,596.00 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（2021）验字第 60739337\_A48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 4 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 301,131,846.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,250.00 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。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含中小板、创业

板、依法发行上市的港股通投资标的股票及中国证监会注册或核准上市的股票)、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、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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。本会计报表的实际编制期间为 2021 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

##### 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中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中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。

转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息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，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

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。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。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。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
活期存款	1,561,320.14
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	1,561,320.14

#### 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	49,784,270.08	46,175,983.86	-3,608,286.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	49,784,270.08	46,175,983.86	-3,608,286.22

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有新城发展配股权证 190 份，公允价值为人民币 0.00 元。

#### 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
应收活期存款利息	174.56
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	140.94
应收债券利息	-

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.52
合计	319.02

#### 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
交易所市场应付交易费用	4,437.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,437.33

#### 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
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	140,000.00
应退替代款	1,879,464.63
合计	2,019,464.63

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	301,131,846.00	301,131,846.00
本期申购	20,000,000.00	20,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-270,000,000.00	-270,000,000.00
本期末	51,131,846.00	51,131,846.00

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 301,129,596.00 元，根据本基金招募说明书的规

定,认购资金在募集期间产生的利息 85,547.75 元在本基金合同生效后,折算为 2,250.00 份基金份额,计入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	568,575.98	-3,608,286.22	-3,039,710.24
本期基金份额交易产生的变动数	-94,943.61	-642,867.89	-737,811.50
其中:基金申购款	338,029.55	-1,011,043.76	-673,014.21
基金赎回款	-432,973.16	368,175.87	-64,797.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	473,632.37	-4,251,154.11	-3,777,521.74

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	39,297.99
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	17,100.01
其他	1,920.02
合计	58,318.02

#### 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 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	356,359.84
股票投资收益——赎回差价收入	31,336.59
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	387,696.43

##### 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 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	190,669,256.98
减：卖出股票成本总额	190,312,897.14
买卖股票差价收入	356,359.84

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	270,064,797.29
减：现金支付赎回款总额	186,496,344.29
减：赎回股票成本总额	83,537,116.41
赎回差价收入	31,336.59

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	304.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200.00
减：应收利息总额	0.03
买卖债券差价收入	104.57

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

单位：人民币元

项目	本期
	2021年4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出权证成交总额	93.04

减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	2.71
买卖权证差价收入	90.33

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

#### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	896,684.21
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	896,684.21

#### 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4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-3,608,286.22
——股票投资	-3,608,286.22
——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	-
——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	-3,608,286.22

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日

基金赎回费收入	-
替代损益	199,447.52
其他	83,297.75
合计	282,745.27

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	613,150.19
银行间市场交易费用	-
合计	613,150.19

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	90,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	6,662.32
合计	146,662.32

#### 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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

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4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	374,402,574.69	73.76%

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4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	304.60	100.00%

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4月7日（基金合同生效日）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	172,825.03	73.71%	-	-

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4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	247,708.34
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	49,541.71

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。

#### 7.4.10.3 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

无。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末	
	2021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
中信证券	12,458,846.00	24.37%

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。

#### 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4月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	1,561,320.14	39,297.99

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。

#### 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4月7日（基金合同生效日）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	601825	沪农商行	新股发行	10,394	92,506.60
中信证券	600905	三峡能源	新股发行	34,000	90,100.00
中信证券	600955	维远股份	新股发行	932	27,549.92
中信证券	600935	华塑股份	新股发行	4,811	18,955.34
中信证券	002142	宁波银行	配股发行	500	9,985.00
中信证券	605488	福莱新材	新股发行	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	新股发行	1,754	6,437.18
中信证券	605566	福莱茵特	新股发行	174	5,604.54
中信证券	605020	永和股份	新股发行	733	5,079.69
中信证券	001219	青岛食品	新股发行	263	4,523.60
中信证券	688690	纳微科技	新股发行	500	4,035.00
中信证券	605138	盛泰集团	新股发行	383	3,818.51
中信证券	605599	菜百股份	新股发行	323	3,230.00
中信证券	688425	铁建重工	新股发行	500	1,435.00

#### 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（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 321,541.40 元，占基金资产净值的比例为 0.68%。

于 2021 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 311,953.06 元，占基金资产净值的比例为 0.66%。

#### 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
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新发流通受限	16.53	16.53	277	4,578.81	4,578.81	-

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。

#### 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之内。

#### 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	-	17,711,997.92	17,711,997.92
衍生金融资产	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	-	-	-
应收股利	-	3,295.20	3,295.20
应收申购款	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产合计	-	17,715,293.12	17,715,293.12
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
	港币相对人民币升值 5%	885,764.66
	港币相对人民币贬值 5%	-885,764.66

## 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	46,175,983.86	97.51
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	46,175,983.86	97.51

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	除中证沪港深 500 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
	-5%	-2,281,446.14
	+5%	2,281,446.14

#### 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 46,175,983.86 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	46,175,983.86	93.46
	其中:股票	46,175,983.86	93.46
2	基金投资	-	-
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	3,127,233.37	6.33
8	其他各项资产	101,396.10	0.21
9	合计	49,404,613.33	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 17,711,997.92 元,占基金资产净值比例为 37.40%。

### 8.2 报告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

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	302,405.20	0.64
B	采矿业	596,833.00	1.26
C	制造业	16,865,364.36	35.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	656,562.00	1.39

E	建筑业	505,428.20	1.07
F	批发和零售业	142,529.80	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	726,305.90	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,005,146.10	2.12
J	金融业	6,018,892.34	12.71
K	房地产业	497,137.80	1.05
L	租赁和商务服务业	366,486.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	421,315.60	0.89
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	18,078.00	0.04
Q	卫生和社会工作	242,088.64	0.51
R	文化、体育和娱乐业	99,413.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	28,463,985.94	60.11

### 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（%）
金融	5,133,072.70	10.84
通讯服务	3,558,105.27	7.51
非必需消费品	2,906,843.95	6.14
房地产	1,278,351.95	2.70
信息技术	905,303.95	1.91
工业	904,228.81	1.91
保健	884,799.35	1.87
必需消费品	815,408.82	1.72
公用事业	755,443.59	1.60
能源	367,020.64	0.78
材料	203,418.89	0.43
合计	17,711,997.92	37.40

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	8,100	3,025,185.41	6.39
2	600519	贵州茅台	700	1,435,000.00	3.03
3	03690	美团-W	7,400	1,363,724.10	2.88
4	601318	中国平安	13,400	675,494.00	1.43
4	02318	中国平安	9,000	413,174.16	0.87
5	600036	招商银行	15,400	750,134.00	1.58

5	03968	招商银行	5,500	272,281.24	0.57
6	300750	宁德时代	1,700	999,600.00	2.11
7	00005	汇丰控股	24,800	950,966.91	2.01
8	01299	友邦保险	14,600	938,245.06	1.98
9	00939	建设银行	144,000	635,765.76	1.34
9	601939	建设银行	8,300	48,638.00	0.10
10	01398	工商银行	104,000	374,133.76	0.79
10	601398	工商银行	43,400	200,942.00	0.42
11	00388	香港交易所	1,500	558,502.56	1.18
12	000858	五粮液	2,400	534,384.00	1.13
13	002594	比亚迪	1,100	294,932.00	0.62
13	01211	比亚迪股份	1,000	217,972.16	0.46
14	601012	隆基股份	5,320	458,584.00	0.97
15	000333	美的集团	6,100	450,241.00	0.95
16	300059	东方财富	10,220	379,264.20	0.80
17	02269	药明生物	5,000	378,344.40	0.80
18	601166	兴业银行	18,000	342,720.00	0.72
19	600900	长江电力	14,600	331,420.00	0.70
20	01810	小米集团-W	21,000	324,505.44	0.69
21	600030	中信证券	10,600	279,946.00	0.59
21	06030	中信证券	2,500	41,595.40	0.09
22	00669	创科实业	2,500	317,228.80	0.67
23	03988	中国银行	101,000	232,043.06	0.49
23	601988	中国银行	26,200	79,910.00	0.17
24	600887	伊利股份	7,500	310,950.00	0.66
25	002415	海康威视	5,800	303,456.00	0.64
26	002475	立讯精密	6,100	300,120.00	0.63
27	603259	药明康德	2,520	298,821.60	0.63
28	00941	中国移动	7,500	286,977.60	0.61
29	600276	恒瑞医药	5,520	279,919.20	0.59
30	601888	中国中免	1,200	263,292.00	0.56
31	601328	交通银行	34,100	157,201.00	0.33
31	03328	交通银行	21,000	80,868.82	0.17
32	600690	海尔智家	4,700	140,483.00	0.30
32	06690	海尔智家	3,400	91,595.73	0.19
33	688981	中芯国际	2,363	125,215.37	0.26
33	00981	中芯国际	7,000	106,794.91	0.23
34	000568	泸州老窖	900	228,483.00	0.48
35	601899	紫金矿业	17,900	173,630.00	0.37
35	02899	紫金矿业	6,000	45,523.97	0.10
36	000651	格力电器	5,900	218,477.00	0.46
37	02331	李宁	3,000	209,346.48	0.44
38	601288	农业银行	43,600	128,184.00	0.27
38	01288	农业银行	37,000	81,073.22	0.17

39	600309	万华化学	2,000	202,000.00	0.43
40	000002	万科 A	8,400	165,984.00	0.35
40	02202	万科企业	2,300	34,111.91	0.07
41	000001	平安银行	12,000	197,760.00	0.42
42	300760	迈瑞医疗	500	190,400.00	0.40
43	300274	阳光电源	1,300	189,540.00	0.40
44	000725	京东方 A	37,300	188,365.00	0.40
45	002142	宁波银行	4,900	187,572.00	0.40
46	603501	韦尔股份	600	186,462.00	0.39
47	02382	舜宇光学科技	900	181,458.14	0.38
48	002714	牧原股份	3,320	177,155.20	0.37
49	09633	农夫山泉	4,200	176,675.18	0.37
50	601601	中国太保	4,200	113,904.00	0.24
50	02601	中国太保	3,400	58,793.62	0.12
51	600031	三一重工	7,400	168,720.00	0.36
52	600585	海螺水泥	3,000	120,900.00	0.26
52	00914	海螺水泥	1,500	47,768.28	0.10
53	603288	海天味业	1,600	168,176.00	0.36
54	300014	亿纬锂能	1,400	165,452.00	0.35
55	002352	顺丰控股	2,400	165,408.00	0.35
56	600809	山西汾酒	520	164,205.60	0.35
57	002241	歌尔股份	3,000	162,300.00	0.34
58	00002	中电控股	2,500	160,965.00	0.34
59	02333	长城汽车	4,000	87,646.72	0.19
59	601633	长城汽车	1,500	72,810.00	0.15
60	00386	中国石油化工股份	30,000	89,036.64	0.19
60	600028	中国石化	16,600	70,218.00	0.15
61	02628	中国人寿	9,000	95,070.53	0.20
61	601628	中国人寿	2,100	63,189.00	0.13
62	300124	汇川技术	2,300	157,780.00	0.33
63	00016	新鸿基地产	2,000	154,689.92	0.33
64	02020	安踏体育	1,600	152,923.91	0.32
65	600438	通威股份	3,400	152,864.00	0.32
66	601088	中国神华	4,100	92,332.00	0.19
66	01088	中国神华	4,000	59,782.91	0.13
67	002812	恩捷股份	600	150,240.00	0.32
68	601919	中远海控	7,910	147,837.90	0.31
69	600837	海通证券	12,000	147,120.00	0.31
70	02319	蒙牛乳业	4,000	144,551.68	0.31
71	00883	中国海洋石油	22,000	144,437.22	0.31
72	00001	长和	3,500	143,938.48	0.30
73	002460	赣锋锂业	1,000	142,850.00	0.30
74	300015	爱尔眼科	3,363	142,187.64	0.30

75	600048	保利发展	8,900	139,107.00	0.29
76	00003	香港中华煤气	13,800	136,974.16	0.29
77	600406	国电南瑞	3,420	136,902.60	0.29
78	02313	申洲国际	1,100	134,814.06	0.28
79	00857	中国石油股份	26,000	73,763.87	0.16
79	601857	中国石油	12,100	59,411.00	0.13
80	603799	华友钴业	1,200	132,372.00	0.28
81	06160	百济神州	1,000	131,633.60	0.28
82	601658	邮储银行	13,500	68,850.00	0.15
82	01658	邮储银行	14,000	62,611.81	0.13
83	600436	片仔癀	300	131,145.00	0.28
84	000063	中兴通讯	3,900	130,650.00	0.28
85	601668	中国建筑	25,900	129,500.00	0.27
86	300122	智飞生物	1,000	124,600.00	0.26
87	600000	浦发银行	14,500	123,685.00	0.26
88	600111	北方稀土	2,700	123,660.00	0.26
89	00175	吉利汽车	7,000	121,904.16	0.26
90	600016	民生银行	30,800	120,120.00	0.25
91	02688	新奥能源	1,000	120,023.68	0.25
92	600104	上汽集团	5,800	119,654.00	0.25
93	601816	京沪高铁	24,400	117,852.00	0.25
94	01024	快手-W	2,000	117,816.16	0.25
95	002129	中环股份	2,800	116,900.00	0.25
96	600745	闻泰科技	900	116,370.00	0.25
97	002271	东方雨虹	2,200	115,896.00	0.24
98	002230	科大讯飞	2,200	115,522.00	0.24
99	002304	洋河股份	700	115,311.00	0.24
100	06098	碧桂园服务	3,000	114,545.76	0.24
101	601688	华泰证券	6,400	113,664.00	0.24
102	002049	紫光国微	500	112,500.00	0.24
103	300142	沃森生物	2,000	112,400.00	0.24
104	603986	兆易创新	620	109,027.00	0.23
105	600893	航发动力	1,700	107,882.00	0.23
106	000100	TCL 科技	17,400	107,358.00	0.23
107	01109	华润置地	4,000	107,269.12	0.23
108	300498	温氏股份	5,500	105,930.00	0.22
109	000338	潍柴动力	5,900	105,551.00	0.22
110	00011	恒生银行	900	105,004.37	0.22
111	02388	中银香港	5,000	104,448.40	0.22
112	00291	华润啤酒	2,000	104,407.52	0.22
113	002027	分众传媒	12,600	103,194.00	0.22
114	01113	长实集团	2,500	100,462.60	0.21
115	601211	国泰君安	5,600	100,184.00	0.21
116	300450	先导智能	1,340	99,655.80	0.21

117	600089	特变电工	4,700	99,499.00	0.21
118	00027	银河娱乐	3,000	99,093.12	0.21
119	601766	中国中车	15,100	91,959.00	0.19
120	000776	广发证券	3,700	90,983.00	0.19
121	600050	中国联通	23,100	90,783.00	0.19
122	600570	恒生电子	1,420	88,253.00	0.19
123	601229	上海银行	12,300	87,699.00	0.19
124	002821	凯莱英	200	87,000.00	0.18
125	00066	港铁公司	2,500	85,541.40	0.18
126	600919	江苏银行	14,600	85,118.00	0.18
127	600660	福耀玻璃	1,800	84,852.00	0.18
128	01093	石药集团	12,000	83,100.86	0.18
129	00688	中国海外发展	5,500	83,010.93	0.18
130	000661	长春高新	300	81,420.00	0.17
131	601169	北京银行	18,300	81,252.00	0.17
132	600999	招商证券	4,600	81,190.00	0.17
133	002709	天赐材料	700	80,255.00	0.17
134	600905	三峡能源	10,600	79,606.00	0.17
135	600019	宝钢股份	11,100	79,476.00	0.17
136	00006	电能实业	2,000	79,470.72	0.17
137	600010	包钢股份	28,300	78,957.00	0.17
138	01801	信达生物	2,000	78,898.40	0.17
139	00322	康师傅控股	6,000	78,587.71	0.17
140	00268	金蝶国际	4,000	78,489.60	0.17
141	300782	卓胜微	240	78,432.00	0.17
142	06618	京东健康	1,550	77,874.36	0.16
143	300661	圣邦股份	250	77,250.00	0.16
144	002410	广联达	1,200	76,776.00	0.16
145	601669	中国电建	9,500	76,760.00	0.16
146	300347	泰格医药	600	76,680.00	0.16
147	600958	东方证券	5,200	76,648.00	0.16
148	600588	用友网络	2,100	75,348.00	0.16
149	600196	复星医药	1,500	73,410.00	0.16
150	002311	海大集团	1,000	73,300.00	0.15
151	601390	中国中铁	12,600	72,954.00	0.15
152	000625	长安汽车	4,780	72,608.20	0.15
153	601985	中国核电	8,700	72,210.00	0.15
154	01193	华润燃气	2,000	72,030.56	0.15
155	000166	申万宏源	14,000	71,680.00	0.15
156	01177	中国生物制药	16,000	71,425.54	0.15
157	300408	三环集团	1,600	71,360.00	0.15
158	688599	天合光能	894	70,536.60	0.15
159	601877	正泰电器	1,300	70,057.00	0.15
160	000895	双汇发展	2,200	69,410.00	0.15

161	002371	北方华创	200	69,404.00	0.15
162	002493	荣盛石化	3,750	68,100.00	0.14
163	601818	光大银行	20,500	68,060.00	0.14
164	002074	国轩高科	1,300	66,625.00	0.14
165	601377	兴业证券	6,700	66,196.00	0.14
166	06969	思摩尔国际	2,000	64,999.20	0.14
167	002459	晶澳科技	700	64,890.00	0.14
168	02618	京东物流	3,000	64,876.56	0.14
169	00968	信义光能	6,000	64,852.03	0.14
170	01997	九龙仓置业	2,000	64,753.92	0.14
171	300207	欣旺达	1,500	63,240.00	0.13
172	00267	中信股份	10,000	62,955.20	0.13
173	000538	云南白药	600	62,790.00	0.13
174	00586	海螺创业	2,000	62,301.12	0.13
175	02007	碧桂园	11,000	62,235.71	0.13
176	000768	中航西飞	1,700	62,050.00	0.13
177	002001	新和成	1,960	60,995.20	0.13
178	002179	中航光电	600	60,336.00	0.13
179	00960	龙湖集团	2,000	60,011.84	0.13
180	688036	传音控股	382	59,935.80	0.13
181	601989	中国重工	14,200	59,924.00	0.13
182	600346	恒力石化	2,600	59,722.00	0.13
183	601138	工业富联	5,000	59,600.00	0.13
184	01928	金沙中国有限公司	4,000	59,390.46	0.13
185	601600	中国铝业	9,700	59,073.00	0.12
186	00992	联想集团	8,000	58,605.57	0.12
187	601225	陕西煤业	4,800	58,560.00	0.12
188	002050	三花智控	2,300	58,190.00	0.12
189	603659	璞泰来	360	57,819.60	0.12
190	600150	中国船舶	2,300	57,017.00	0.12
191	600426	华鲁恒升	1,820	56,966.00	0.12
192	600741	华域汽车	2,000	56,600.00	0.12
193	00425	敏实集团	2,000	56,169.12	0.12
194	600009	上海机场	1,200	56,028.00	0.12
195	01821	ESR	2,600	56,013.78	0.12
196	002202	金风科技	3,400	55,998.00	0.12
197	300316	晶盛机电	800	55,600.00	0.12
198	601009	南京银行	6,200	55,552.00	0.12
199	300496	中科创达	400	55,368.00	0.12
200	300433	蓝思科技	2,400	55,152.00	0.12
201	00012	恒基地产	2,000	54,288.64	0.11
202	600460	士兰微	1,000	54,200.00	0.11
203	002008	大族激光	1,000	54,000.00	0.11



204	300896	爱美客	100	53,611.00	0.11
205	00998	中信银行	13,000	35,925.34	0.08
205	601998	中信银行	3,800	17,556.00	0.04
206	001979	招商蛇口	4,000	53,360.00	0.11
207	600176	中国巨石	2,929	53,307.80	0.11
208	688111	金山办公	200	53,000.00	0.11
209	600011	华能国际	5,400	52,326.00	0.11
210	002236	大华股份	2,200	51,656.00	0.11
211	300413	芒果超媒	900	51,498.00	0.11
212	600522	中天科技	3,000	50,880.00	0.11
213	688012	中微公司	400	50,640.00	0.11
214	00017	新世界发展	2,000	50,445.92	0.11
215	03908	中金公司	2,000	35,156.80	0.07
215	601995	中金公司	300	14,709.00	0.03
216	601066	中信建投	1,700	49,725.00	0.11
217	00881	中升控股	1,000	49,710.08	0.10
218	688008	澜起科技	592	49,651.04	0.10
219	601100	恒立液压	600	49,080.00	0.10
220	000596	古井贡酒	200	48,800.00	0.10
221	603993	洛阳钼业	8,700	48,546.00	0.10
222	00868	信义玻璃	3,000	47,829.60	0.10
223	600926	杭州银行	3,700	47,434.00	0.10
224	601006	大秦铁路	7,400	47,360.00	0.10
225	603806	福斯特	360	46,998.00	0.10
226	002602	世纪华通	5,600	46,984.00	0.10
227	03323	中国建材	6,000	46,897.54	0.10
228	600989	宝丰能源	2,700	46,872.00	0.10
229	600584	长电科技	1,500	46,530.00	0.10
230	600760	中航沈飞	680	46,267.20	0.10
231	01308	海丰国际	2,000	46,112.64	0.10
232	002384	东山精密	1,700	46,070.00	0.10
233	002555	三七互娱	1,700	45,934.00	0.10
234	601360	三六零	3,600	45,792.00	0.10
235	003816	中国广核	14,600	45,698.00	0.10
236	601117	中国化学	3,800	45,600.00	0.10
237	601555	东吴证券	5,030	44,565.80	0.09
238	601233	桐昆股份	2,100	44,478.00	0.09
239	601186	中国铁建	5,700	44,460.00	0.09
240	000157	中联重科	6,200	44,454.00	0.09
241	000963	华东医药	1,100	44,220.00	0.09
242	00288	万洲国际	11,000	43,978.70	0.09
243	601868	中国能建	16,100	43,953.00	0.09
244	002013	中航机电	2,400	43,632.00	0.09
245	600547	山东黄金	2,300	43,286.00	0.09

246	00241	阿里健康	8,000	43,103.87	0.09
247	002385	大北农	4,100	43,009.00	0.09
248	000977	浪潮信息	1,200	42,996.00	0.09
248	000786	北新建材	1,200	42,996.00	0.09
250	600029	南方航空	6,300	42,903.00	0.09
251	002601	龙佰集团	1,500	42,885.00	0.09
252	06186	中国飞鹤	5,000	42,760.48	0.09
253	00836	华润电力	2,000	42,678.72	0.09
254	000876	新希望	2,800	42,588.00	0.09
255	600015	华夏银行	7,600	42,560.00	0.09
256	000799	酒鬼酒	200	42,500.00	0.09
257	002920	德赛西威	300	42,453.00	0.09
258	600219	南山铝业	8,900	41,919.00	0.09
259	02328	中国财险	8,000	41,664.90	0.09
260	002736	国信证券	3,600	41,328.00	0.09
261	01929	周大福	3,600	41,265.91	0.09
262	000938	紫光股份	1,800	41,130.00	0.09
263	601238	广汽集团	2,700	41,013.00	0.09
264	00151	中国旺旺	7,000	40,978.11	0.09
265	601799	星宇股份	200	40,850.00	0.09
266	01038	长江基建集团	1,000	40,593.84	0.09
267	600352	浙江龙盛	3,200	40,416.00	0.09
268	600886	国投电力	3,500	40,145.00	0.08
269	000425	徐工机械	6,700	40,133.00	0.08
270	002648	卫星化学	1,000	40,030.00	0.08
271	600763	通策医疗	200	39,800.00	0.08
272	600600	青岛啤酒	400	39,600.00	0.08
273	300601	康泰生物	400	39,416.00	0.08
274	00788	中国铁塔	56,000	39,375.62	0.08
275	00101	恒隆地产	3,000	39,342.91	0.08
276	03888	金山软件	1,400	39,203.92	0.08
277	601901	方正证券	5,000	39,200.00	0.08
278	00004	九龙仓集团	2,000	39,163.04	0.08
279	601336	新华保险	1,000	38,880.00	0.08
280	603019	中科曙光	1,400	38,598.00	0.08
281	01918	融创中国	4,000	38,525.31	0.08
282	300454	深信服	200	38,200.00	0.08
283	603369	今世缘	700	38,080.00	0.08
284	002007	华兰生物	1,300	37,882.00	0.08
285	601800	中国交建	4,400	37,752.00	0.08
286	300253	卫宁健康	2,200	36,872.00	0.08
287	09992	泡泡玛特	1,000	36,546.72	0.08
288	002791	坚朗五金	200	36,318.00	0.08
289	600383	金地集团	2,800	36,316.00	0.08

290	600298	安琪酵母	600	36,216.00	0.08
291	300003	乐普医疗	1,600	36,208.00	0.08
292	000783	长江证券	4,800	36,192.00	0.08
293	601916	浙商银行	10,300	36,050.00	0.08
294	000069	华侨城 A	5,100	35,904.00	0.08
295	00135	昆仑能源	6,000	35,859.94	0.08
296	601788	光大证券	2,400	35,832.00	0.08
297	002185	华天科技	2,800	35,588.00	0.08
298	01876	百威亚太	2,100	35,111.83	0.07
299	600918	中泰证券	3,500	34,895.00	0.07
300	000301	东方盛虹	1,800	34,812.00	0.07
301	601865	福莱特	600	34,764.00	0.07
302	600115	中国东航	6,700	34,572.00	0.07
303	601108	财通证券	3,100	34,472.00	0.07
304	00384	中国燃气	2,600	34,437.31	0.07
305	300595	欧普康视	600	34,422.00	0.07
306	603345	安井食品	200	34,156.00	0.07
307	002252	上海莱士	5,000	34,100.00	0.07
308	600109	国金证券	3,000	33,990.00	0.07
309	002938	鹏鼎控股	800	33,944.00	0.07
310	601111	中国国航	3,700	33,781.00	0.07
311	601618	中国中冶	8,800	33,704.00	0.07
312	002180	纳思达	700	33,432.00	0.07
313	603882	金域医学	300	33,411.00	0.07
314	600183	生益科技	1,400	32,970.00	0.07
315	01044	恒安国际	1,000	32,826.64	0.07
316	300628	亿联网络	400	32,580.00	0.07
317	00270	粤海投资	4,000	32,409.66	0.07
318	601838	成都银行	2,700	32,400.00	0.07
319	601155	新城控股	1,100	32,043.00	0.07
320	00083	信和置业	4,000	31,755.58	0.07
321	300999	金龙鱼	500	31,465.00	0.07
322	000066	中国长城	2,200	31,152.00	0.07
323	03692	翰森制药	2,000	31,068.80	0.07
324	688363	华熙生物	200	31,060.00	0.07
325	603392	万泰生物	140	31,010.00	0.07
326	601727	上海电气	6,300	30,618.00	0.06
327	688180	君实生物	457	30,609.86	0.06
328	01378	中国宏桥	4,500	30,279.82	0.06
329	600132	重庆啤酒	200	30,264.00	0.06
330	603486	科沃斯	200	30,190.00	0.06
331	601077	渝农商行	7,700	29,645.00	0.06
332	603833	欧派家居	200	29,500.00	0.06
333	01579	颐海国际	1,000	29,474.48	0.06

334	000728	国元证券	3,800	29,260.00	0.06
335	601966	玲珑轮胎	800	29,240.00	0.06
336	600362	江西铜业	1,300	29,029.00	0.06
337	600143	金发科技	2,300	28,934.00	0.06
338	300033	同花顺	200	28,916.00	0.06
339	000703	恒逸石化	2,700	28,674.00	0.06
340	002120	韵达股份	1,400	28,644.00	0.06
341	300144	宋城演艺	2,000	28,640.00	0.06
342	002624	完美世界	1,400	28,434.00	0.06
343	600233	圆通速递	1,700	28,356.00	0.06
344	603589	口子窖	400	28,348.00	0.06
345	300759	康龙化成	200	28,254.00	0.06
346	603737	三棵树	200	27,830.00	0.06
347	601607	上海医药	1,400	27,818.00	0.06
348	002414	高德红外	1,140	27,599.40	0.06
349	00522	ASM PACIFIC	400	27,553.12	0.06
350	600332	白云山	800	27,360.00	0.06
351	603517	绝味食品	400	27,332.00	0.06
352	600079	人福医药	1,200	27,024.00	0.06
353	300146	汤臣倍健	1,000	26,960.00	0.06
354	601990	南京证券	2,700	26,757.00	0.06
355	002044	美年健康	3,400	26,690.00	0.06
356	300529	健帆生物	500	26,650.00	0.06
357	002673	西部证券	3,300	26,631.00	0.06
358	603260	合盛硅业	200	26,394.00	0.06
359	601878	浙商证券	2,000	26,360.00	0.06
360	600061	国投资本	3,192	26,238.24	0.06
361	600705	中航产融	6,600	26,202.00	0.06
362	300677	英科医疗	450	26,028.00	0.05
363	600188	兖矿能源	1,100	25,883.00	0.05
364	603899	晨光文具	400	25,804.00	0.05
365	002600	领益智造	3,500	25,760.00	0.05
366	00853	微创医疗	1,100	25,541.82	0.05
367	00762	中国联通	8,000	25,509.12	0.05
368	01066	威高股份	3,200	25,456.79	0.05
369	02018	瑞声科技	1,000	25,182.08	0.05
370	601728	中国电信	5,800	25,114.00	0.05
371	000708	中信特钢	1,200	24,576.00	0.05
372	002841	视源股份	300	24,420.00	0.05
373	002916	深南电路	200	24,364.00	0.05
374	600038	中直股份	300	24,090.00	0.05
375	00772	阅文集团	600	24,037.44	0.05
376	600779	水井坊	200	23,998.00	0.05
377	002568	百润股份	400	23,932.00	0.05

378	600521	华海药业	1,100	23,826.00	0.05
379	01209	华润万象生活	800	23,775.81	0.05
380	600845	宝信软件	390	23,723.70	0.05
381	01999	敏华控股	2,400	23,703.86	0.05
382	600018	上港集团	4,300	23,564.00	0.05
383	00285	比亚迪电子	1,000	23,342.48	0.05
384	601198	东兴证券	2,000	23,260.00	0.05
385	00144	招商局港口	2,000	23,219.84	0.05
386	600161	天坛生物	800	23,168.00	0.05
387	603816	顾家家居	300	23,148.00	0.05
388	00884	旭辉控股集团	6,000	23,007.26	0.05
389	000860	顺鑫农业	600	22,908.00	0.05
390	601696	中银证券	1,700	22,865.00	0.05
391	600872	中炬高新	600	22,782.00	0.05
392	01972	太古地产	1,400	22,366.27	0.05
393	601216	君正集团	4,200	21,966.00	0.05
394	601162	天风证券	5,400	21,870.00	0.05
395	600369	西南证券	4,100	21,689.00	0.05
396	603160	汇顶科技	200	21,554.00	0.05
397	01691	J S 环球生活	2,000	21,486.53	0.05
398	600606	绿地控股	4,780	20,745.20	0.04
399	00656	复星国际	3,000	20,628.05	0.04
400	300866	安克创新	200	20,500.00	0.04
401	688126	沪硅产业	784	20,242.88	0.04
402	600372	中航电子	900	20,151.00	0.04
403	600674	川投能源	1,600	20,000.00	0.04
404	603939	益丰药房	360	19,839.60	0.04
405	00817	中国金茂	10,000	19,704.16	0.04
406	000050	深天马 A	1,500	19,530.00	0.04
407	06110	滔搏	3,000	19,352.59	0.04
408	002157	正邦科技	2,000	19,320.00	0.04
409	300251	光线传媒	1,500	19,275.00	0.04
410	01313	华润水泥控股	4,000	19,262.66	0.04
411	300957	贝泰妮	100	19,228.00	0.04
412	600118	中国卫星	700	19,005.00	0.04
413	002024	苏宁易购	4,600	18,952.00	0.04
414	00754	合生创展集团	1,400	18,611.85	0.04
415	601933	永辉超市	4,500	18,225.00	0.04
416	605499	东鹏饮料	100	18,184.00	0.04
417	00019	太古股份公司 A	500	18,130.28	0.04
418	002607	中公教育	2,300	18,078.00	0.04
419	002508	老板电器	500	18,010.00	0.04
420	601881	中国银河	1,600	17,904.00	0.04
421	002064	华峰化学	1,700	17,748.00	0.04

422	300676	华大基因	200	17,560.00	0.04
423	000656	金科股份	3,900	17,472.00	0.04
424	01030	新城发展	4,000	17,235.01	0.04
425	600848	上海临港	1,140	16,951.80	0.04
426	601319	中国人保	3,600	16,920.00	0.04
427	603195	公牛集团	100	16,730.00	0.04
428	603185	上机数控	100	16,698.00	0.04
429	603707	健友股份	390	16,380.00	0.03
430	01833	平安好医生	700	16,225.27	0.03
431	603338	浙江鼎力	200	16,052.00	0.03
432	300558	贝达药业	200	15,966.00	0.03
433	00966	中国太平	1,800	15,746.98	0.03
434	688396	华润微	239	15,439.40	0.03
435	600025	华能水电	2,300	15,157.00	0.03
436	300919	中伟股份	100	15,151.00	0.03
437	002153	石基信息	520	14,944.80	0.03
438	00909	明源云	1,000	14,520.58	0.03
439	601898	中煤能源	2,300	14,467.00	0.03
440	06862	海底捞	1,000	14,389.76	0.03
441	603658	安图生物	260	14,315.60	0.03
442	002939	长城证券	1,100	14,245.00	0.03
443	603087	甘李药业	200	14,068.00	0.03
444	601236	红塔证券	1,180	14,065.60	0.03
445	02689	玖龙纸业	2,000	13,686.62	0.03
446	002294	信立泰	500	13,660.00	0.03
447	603233	大参林	320	13,475.20	0.03
448	300832	新产业	300	13,215.00	0.03
449	00880	澳博控股	3,000	12,877.20	0.03
450	601231	环旭电子	800	12,848.00	0.03
451	002032	苏泊尔	200	12,448.00	0.03
452	06993	蓝月亮集团	2,000	12,100.48	0.03
453	601577	长沙银行	1,500	11,715.00	0.02
454	000987	越秀金控	1,345	11,701.50	0.02
455	603866	桃李面包	400	11,360.00	0.02
456	000800	一汽解放	1,100	11,319.00	0.02
457	06666	恒大物业	5,000	10,792.32	0.02
458	601808	中海油服	700	10,500.00	0.02
459	00293	国泰航空	2,000	10,448.93	0.02
460	01128	永利澳门	2,000	10,416.22	0.02
461	03808	中国重汽	1,000	9,811.20	0.02
462	03380	龙光集团	2,000	9,745.79	0.02
463	02588	中银航空租赁	200	9,336.99	0.02
464	06808	高鑫零售	3,500	8,956.81	0.02
465	300979	华利集团	100	8,905.00	0.02

466	00813	世茂集团	2,000	8,339.52	0.02
467	300888	稳健医疗	100	8,245.00	0.02
468	300869	康泰医学	200	8,110.00	0.02
469	601698	中国卫通	500	7,195.00	0.02
470	03383	雅居乐集团	2,000	6,916.90	0.01
471	01516	融创服务	1,000	6,499.92	0.01
472	600299	安迪苏	400	4,928.00	0.01
473	02282	美高梅中国	1,200	4,640.70	0.01
474	001234	泰慕士	277	4,578.81	0.01
475	03333	中国恒大	2,000	2,599.97	0.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	25,545,211.82	53.94
2	600519	贵州茅台	11,898,422.00	25.13
3	601318	中国平安	6,825,412.00	14.41
3	02318	中国平安	4,128,393.14	8.72
4	03690	美团-W	7,781,421.22	16.43
5	01299	友邦保险	7,377,214.85	15.58
6	600036	招商银行	5,339,145.00	11.27
6	03968	招商银行	1,741,144.75	3.68
7	00005	汇丰控股	5,908,035.69	12.48
8	00939	建设银行	4,878,617.53	10.30
8	601939	建设银行	404,666.00	0.85
9	01398	工商银行	2,938,903.26	6.21
9	601398	工商银行	1,580,499.00	3.34
10	000858	五粮液	4,430,740.00	9.36
11	300750	宁德时代	3,937,523.00	8.32
12	00388	香港交易所	3,694,664.91	7.80
13	000333	美的集团	3,463,135.68	7.31
14	300760	迈瑞医疗	2,555,885.97	5.40
15	601166	兴业银行	2,542,222.70	5.37
16	600276	恒瑞医药	2,532,561.00	5.35
17	000651	格力电器	2,495,489.00	5.27
18	601888	中国中免	2,408,947.00	5.09
19	002594	比亚迪	1,415,382.00	2.99
19	01211	比亚迪股份	841,798.33	1.78
20	02269	药明生物	2,201,003.00	4.65

21	03988	中国银行	1,589,662.78	3.36
21	601988	中国银行	584,926.00	1.24
22	002415	海康威视	2,051,795.50	4.33
23	601012	隆基股份	2,047,726.00	4.32
24	01810	小米集团-W	2,024,972.70	4.28
25	600887	伊利股份	2,022,447.00	4.27
26	600030	中信证券	1,747,321.00	3.69
26	06030	中信证券	269,444.55	0.57
27	000002	万科 A	1,687,755.00	3.56
27	02202	万科企业	327,972.99	0.69
28	00941	中国移动	1,928,756.19	4.07
29	300059	东方财富	1,853,472.00	3.91
30	000001	平安银行	1,771,050.00	3.74
31	002714	牧原股份	1,694,706.00	3.58
32	000725	京东方 A	1,674,358.00	3.54
33	601328	交通银行	1,120,876.00	2.37
33	03328	交通银行	543,573.35	1.15
34	603501	韦尔股份	1,649,064.00	3.48
35	000661	长春高新	1,633,897.60	3.45
36	600031	三一重工	1,629,421.00	3.44
37	600900	长江电力	1,605,435.00	3.39
38	000568	泸州老窖	1,553,347.00	3.28
39	601601	中国太保	987,820.00	2.09
39	02601	中国太保	497,306.82	1.05
40	603259	药明康德	1,479,116.00	3.12
41	600309	万华化学	1,425,931.00	3.01
42	600585	海螺水泥	1,012,738.00	2.14
42	00914	海螺水泥	408,648.31	0.86
43	601288	农业银行	821,006.00	1.73
43	01288	农业银行	591,566.60	1.25
44	603288	海天味业	1,372,966.00	2.90
45	002475	立讯精密	1,342,439.00	2.83
46	600809	山西汾酒	1,322,556.00	2.79
47	00669	创科实业	1,301,800.90	2.75
48	601899	紫金矿业	1,214,306.00	2.56
48	02899	紫金矿业	66,059.26	0.14
49	600436	片仔癀	1,258,397.00	2.66
50	300122	智飞生物	1,221,982.00	2.58
51	02628	中国人寿	719,772.36	1.52
51	601628	中国人寿	427,711.00	0.90
52	00386	中国石油化工股份	669,807.75	1.41
52	600028	中国石化	462,083.00	0.98
53	600690	海尔智家	998,430.00	2.11
53	06690	海尔智家	116,120.93	0.25



54	000100	TCL 科技	1,097,420.00	2.32
55	600016	民生银行	888,463.00	1.88
55	01988	民生银行	177,392.68	0.37
56	002304	洋河股份	1,061,527.34	2.24
57	00001	长和	1,058,121.32	2.23
58	00016	新鸿基地产	1,052,170.79	2.22
59	002142	宁波银行	1,040,841.00	2.20
60	600000	浦发银行	1,029,357.00	2.17
61	002352	顺丰控股	1,025,580.00	2.17
62	02020	安踏体育	1,009,685.94	2.13
63	02331	李宁	983,328.02	2.08
64	02313	申洲国际	960,968.92	2.03
65	00002	中电控股	956,540.26	2.02

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	21,161,063.41	44.69
2	01299	友邦保险	6,133,747.07	12.95
3	03690	美团-W	5,951,563.94	12.57
4	00005	汇丰控股	4,982,320.44	10.52
5	02318	中国平安	3,316,205.03	7.00
5	601318	中国平安	941,823.00	1.99
6	00939	建设银行	3,997,040.68	8.44
6	601939	建设银行	62,286.00	0.13
7	000858	五粮液	4,015,948.00	8.48
8	300750	宁德时代	3,331,777.00	7.04
9	00388	香港交易所	3,150,903.56	6.65
10	000333	美的集团	2,919,505.00	6.17
11	01398	工商银行	2,366,125.50	5.00
11	601398	工商银行	229,283.00	0.48
12	03968	招商银行	1,557,691.27	3.29
12	600036	招商银行	865,940.00	1.83
13	300760	迈瑞医疗	2,421,638.00	5.11
14	000651	格力电器	2,096,306.00	4.43
15	02269	药明生物	1,860,140.07	3.93
16	002594	比亚迪	1,159,650.00	2.45
16	01211	比亚迪股份	693,318.64	1.46
17	002415	海康威视	1,748,743.00	3.69
18	000002	万科 A	1,415,009.04	2.99

18	02202	万科企业	263,329.64	0.56
19	01810	小米集团-W	1,653,513.86	3.49
20	000001	平安银行	1,642,614.00	3.47
21	300059	东方财富	1,641,175.00	3.47
22	00941	中国移动	1,619,625.42	3.42
23	000661	长春高新	1,516,772.00	3.20
24	002714	牧原股份	1,462,580.00	3.09
25	03988	中国银行	1,328,646.05	2.81
25	601988	中国银行	86,815.00	0.18
26	000568	泸州老窖	1,404,252.00	2.97
27	000725	京东方 A	1,393,700.00	2.94
28	002475	立讯精密	1,129,437.20	2.39
29	300122	智飞生物	1,082,937.00	2.29
30	002304	洋河股份	1,009,869.37	2.13
31	00669	创科实业	998,047.84	2.11

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	317,662,083.63
卖出股票收入（成交）总额	190,669,256.98

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

1	02997	新城发展股 权	190.00	-	-
---	-------	------------	--------	---	---

#### 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，招商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、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，招商银行、建设银行、美团-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	17,632.25
2	应收证券清算款	80,149.63
3	应收股利	3,295.20
4	应收利息	319.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,396.10

##### 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

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
883	57,906.96	25,997,046.00	50.84%	25,134,800.00	49.16%

### 9.2 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	中信证券股份有限公司	12,458,846.00	24.37%
2	中信建投证券股份有限公司	7,974,800.00	15.60%
3	华泰证券股份有限公司	2,210,100.00	4.32%
4	中泰证券股份有限公司	1,249,400.00	2.44%
5	罗朝军	1,001,000.00	1.96%
6	王玉良	1,000,000.00	1.96%
6	华夏基金—中信证券股份有限公司— 华夏基金—中信证券消费增强单一资 产管理计划	1,000,000.00	1.96%
8	海通证券股份有限公司	603,900.00	1.18%
9	高庆云	600,000.00	1.17%
10	杭州之联实业有限公司	500,000.00	0.98%

### 9.3 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	-	-

### 9.4 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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021 年 4 月 7 日)基金份额总额	301,131,846.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	20,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	270,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	51,131,846.00

注：本基金合同于2021年4月7日生效。

## §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。

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。

### 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。本基金本报告期内选聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

### 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	22	374,402,574.69	73.76%	172,825.03	73.71%	-
招商证券	3	99,943,257.04	19.69%	46,537.10	19.85%	-
国盛证券	2	15,066,178.22	2.97%	7,032.41	3.00%	-
中银国际证券	3	5,534,449.00	1.09%	2,387.00	1.02%	-
申万宏源证券	4	3,404,023.55	0.67%	1,579.51	0.67%	-
方正证券	4	2,615,878.22	0.52%	1,131.10	0.48%	-
华泰证券	4	2,430,867.33	0.48%	1,167.51	0.50%	-
海通证券	4	2,324,395.58	0.46%	1,002.60	0.43%	-
长江证券	1	1,851,894.50	0.36%	798.73	0.34%	-

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本基金合同于2021年4月7日生效，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、高华证券、广发证券、国金证券、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、野村东方国际证券、粤开证券、中国银河证

券、中金公司、中信建投证券、中信建投证券证券、中信证券(浙江)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。

### 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		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	304.60	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-

### 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	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-08
2	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
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	2021-04-09
4	华夏基金管理有限公司关于华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
5	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
6	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
7	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
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	2021-04-21
9	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-26
10	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	2021-05-08

	关联方承销证券的公告	网站	
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	2021-05-12
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	2021-05-13
13	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
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	2021-05-19
15	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
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	2021-05-28
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	2021-06-04
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	2021-06-09
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	2021-06-17
20	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-28
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	2021-07-03
22	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-13
23	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-24
24	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-11
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	2021-10-13
26	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-13
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	2021-10-15
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	2021-10-22
29	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
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	2021-11-22
31	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	2021-12-04
32	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券	中国证监会指定报刊及	2021-12-21



	投资基金暂停申购、赎回业务的公告	网站	
33	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	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

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	2021-09-08 至 2021-11-09, 2021-11-12 至 2021-12-31	40,000,000.00	35,186,150.00	62,727,304.00	12,458,846.00	24.37%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

## §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、《华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证沪港深 500 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。

### 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