

**华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数  
证券投资基金  
2022 年中期报告  
2022 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	63

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCIA 股（扩位证券简称：MSCIA 股 ETF）
基金主代码	512990
交易代码	512990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 17 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	185,015,418.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 3 月 25 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，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	95566
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-13,344,671.36
本期利润	-37,327,440.61
加权平均基金份额本期利润	-0.1848
本期加权平均净值利润率	-11.21%
本期基金份额净值增长率	-8.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	133,478,649.48
期末可供分配基金份额利润	0.7214
期末基金资产净值	318,494,067.48
期末基金份额净值	1.7214
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	81.03%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个	10.04%	1.05%	9.38%	1.07%	0.66%	-0.02%

月						
过去三个月	7.64%	1.45%	6.60%	1.46%	1.04%	-0.01%
过去六个月	-8.14%	1.46%	-9.07%	1.46%	0.93%	0.00%
过去一年	-8.69%	1.23%	-12.39%	1.24%	3.70%	-0.01%
过去三年	52.53%	1.26%	28.25%	1.27%	24.28%	-0.01%
自基金转型起至今	81.03%	1.32%	51.77%	1.33%	29.26%	-0.01%

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2018 年 9 月 17 日至 2022 年 6 月 30 日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公

司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，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 2022 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/188、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/188；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 2/14；在定开偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 2/77、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排序第 10/77、华夏磐益一年定开混合排序第 11/77、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 24/77；在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排序第 9/52；在消费行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排序第 10/53；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 22/134；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 29/905、华夏产业升级混合(A 类)排序第 55/905、华夏盛世混合排序第 67/905；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 59/286；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排序第 74/436。

固收与固收+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；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 3/13；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 7/98；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排序第 21/84；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 28/642；在偏债型基金(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排序第 32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、华夏永康添福混合(A 类)排序第 46/350、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排序第 4/19；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；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 3/60、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排序第 15/60;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 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排序第 6/24;在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41;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 15/80;在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上,在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中,华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现,成功获奖。此外,凭借 QDII 基金的良好业绩表现,以及在境内外市场的持续布局,华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面,2022 年上半年,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)华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式,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优化资料上传、定投收益展示等功能,增加客户操作便利性;(3)与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作,拓展更加丰富的客户理财渠道;(4)开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
司帆	本基金的基金经理	2021-10-21	-	11 年	硕士。2011 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员等。

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 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
司帆	公募基金	6	2,428,803,337.04	2021-07-06
	私募资产管理计划	3	13,434,099,760.56	2019-07-25
	其他组合	-	-	-
	合计	9	15,862,903,097.60	



注：报告期内，司帆管理的 1 个私募资产管理计划已于 2022 年 4 月 27 日终止。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 54 次，其中 3 次为投资策略需要所致，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；其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数，MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index) 由 MSCI 公司于 2017 年 10 月 23 日发布，其成份股为 A 股纳入 MSCI 新兴市场指数 (MSCI Emerging Markets Index) 的部分，该指数能够完整反映 A 股逐步纳入 MSCI 新兴市场指数的进程。截至 2022 年 6 月 30 日，MSCI 中国 A 股国际通指数成份股 495 只。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，地缘冲突这一黑天鹅因素造成了包括原油、天然气、金属等资源品的价格上涨，对国内外经济形势都产生了深远影响。

国际方面，大宗商品价格上涨拉动了美国、欧洲等主要经济体的通货膨胀，为应对持续走高的通货膨胀压力，美联储一次性加息 75bp。但在大幅加息的同时，美联储对未来的货币政策发言又偏鸽派，这体现了在当前通胀高位、经济见顶回落阶段，美联储左右矛盾的心态。美国经济的这种类

滞涨状态来自于过去 10 年美国内生需求下行但政策刺激强行拉动总需求保持高位，是处于紧平衡的供需状态遇到大宗商品价格上涨的必然结果，短期内看不到解决的迹象。

国内方面，不但我国企业的盈利受到原材料涨价的冲击，投资者避险情绪也随着地缘冲突的发展而上升，与此同时又叠加疫情影响，导致 A 股行情出现深度回调。5 月后，随着疫情防控进入常态化，我国经济开始进入新一轮疫情经济周期的复苏期，随之 A 股行情也出现较大幅度修复。从国内政策上看，上半年政策延续了去年四季度的“稳增长+调结构”的主轴，在此背景下的货币信用财政三宽的政策格局未变，国内政策态度是积极的。

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广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中信建投证券股份有限公司、海通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 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.7214 元，本报告期份额净值增长率为-8.14%，同期业绩比较基准增长率-9.07%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.93%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，大宗商品价格短期内难以大幅回落，以油价为例，OPEC 有意维持其供给端偏紧的状态，OPEC 增产和美国页岩油增产的希望都不大，预计油价将维持高位。由此也导致在国际方面，通胀问题仍然是制约欧美主要经济体政策的决定性因素，经济的类滞涨状态大概率维持甚至加剧。

国内方面，疫后恢复决定了经济增长反弹的大方向，三季度较二季度有望实现 V 型反弹，增速回到 5.5%左右的高位。经济修复的节奏大概率是基建先行，地产缓至，消费渐进复苏。货币政策相对友好，即便三季度复苏势头较好，货币应该也不会出现快速收紧的情况，但边际上货币环境从目前的宽松状态回归到相对均衡状态是有可能的。

综合以上多方面因素，我们认为证券市场和本指数在下半年将存在比较好的收益机会。

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，充分发挥指数基金的功能，

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

## §6 中期报告财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,206,520.48	17,374,849.96
结算备付金		4,114,142.29	6,112,709.36
存出保证金		2,172,560.17	3,076,620.66
交易性金融资产	6.4.7.2	300,183,619.57	392,464,768.55
其中：股票投资		300,084,293.11	392,457,768.55
基金投资		-	-
债券投资		99,326.46	7,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,094,674.77	89,196.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	5,508.55
资产总计		321,771,517.28	419,123,653.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,893,227.06	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		125,967.26	185,202.91
应付托管费		25,193.43	37,040.57
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.26	10,574.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,233,061.79	962,167.66
负债合计		3,277,449.80	1,194,985.76
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	185,015,418.00	223,015,418.00
未分配利润	6.4.7.8	133,478,649.48	194,913,249.41
净资产合计		318,494,067.48	417,928,667.41
负债和净资产总计		321,771,517.28	419,123,653.17

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7214 元，基金份额总额 185,015,418.00 份。

②以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-36,175,016.91	55,246,857.10
1.利息收入		61,901.20	146,653.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	61,901.20	117,073.93
债券利息收入		-	154.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,931.51
证券出借利息收入		-	27,493.39
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,322,864.91	83,866,725.64

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,999,832.18	77,755,967.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	43,440.93	134,748.04
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-4,066,277.97	1,309,572.81
股利收益	6.4.7.14	2,699,804.31	4,666,437.69
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-23,982,769.25	-28,665,804.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	68,716.05	-100,717.65
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,152,423.70</b>	<b>3,052,996.21</b>
1.管理人报酬		831,293.62	1,890,791.04
2.托管费		166,258.71	378,158.25
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		0.14	4,011.46
8.其他费用	6.4.7.18	154,871.23	780,035.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-37,327,440.61</b>	<b>52,193,860.89</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-37,327,440.61</b>	<b>52,193,860.89</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-37,327,440.61</b>	<b>52,193,860.89</b>

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	223,015,418.00	-	194,913,249.41	417,928,667.41
二、本期期初净资产（基金净值）	223,015,418.00	-	194,913,249.41	417,928,667.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-38,000,000.00	-	-61,434,599.93	-99,434,599.93
（一）、综合收益总额	-	-	-37,327,440.61	-37,327,440.61
（二）、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）	-38,000,000.00	-	-24,107,159.32	-62,107,159.32
其中：1.基金申购款	44,000,000.00	-	28,320,794.21	72,320,794.21
2.基金赎回款	-82,000,000.00	-	-52,427,953.53	-134,427,953.53
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	185,015,418.00	-	133,478,649.48	318,494,067.48
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	474,515,418.00	-	365,234,927.70	839,750,345.70
二、本期期初净资产（基金净值）	474,515,418.00	-	365,234,927.70	839,750,345.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-91,500,000.00	-	-26,189,765.71	-117,689,765.71
（一）、综合收益总额	-	-	52,193,860.89	52,193,860.89
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-91,500,000.00	-	-78,383,626.60	-169,883,626.60
其中：1.基金申购	108,000,000.00	-	90,345,403.82	198,345,403.82

款				
2.基金赎回款	-199,500,000.00	-	-168,729,030.42	-368,229,030.42
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	383,015,418.00	-	339,045,161.99	722,060,579.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 基金基本情况

原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]870 号《关于准予 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 1 月 19 日至 2015 年 2 月 6 日期间共募集 4,136,470,618.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0145 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,136,570,680 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,062 份基金份额。

根据原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金变更标的指数并修订基金合同有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金自 2018 年 9 月 17 日正式变更为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金；MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金自 2018 年 9 月 17 日正式变更为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并继续以变更后的华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金作为目标 ETF。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。



根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示，同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 17,374,849.96 元、6,112,709.36 元、3,076,620.66 元、5,508.55 元和 89,196.09 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 17,376,709.04 元、6,116,311.53 元、3,076,666.86 元、0.00 元和 89,196.09 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 392,464,768.55 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 392,464,769.65 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 185,202.91 元、37,040.57 元、256,567.21 元和 705,600.45 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 185,202.91 元、37,040.57 元、256,567.21 元和 705,600.45 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- (2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。
- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- (4) 存款利息收入不征收增值税。
- (5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- (6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得

的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	14,206,520.48
等于：本金	14,205,221.80
加：应计利息	1,298.68
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	14,206,520.48

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	300,206,842.85	-	300,084,293.11	-122,549.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	90,100.00	22.94	99,326.46	9,203.52
交易所				

	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	90,100.00	22.94	99,326.46	9,203.52
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		300,296,942.85	22.94	300,183,619.57	-113,346.22

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。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	16,039,370.00	-	-	-
其中：股指期货	16,039,370.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	16,039,370.00	-	-	-

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2209	沪深 300 期货 IF2209 合约	10.00	13,341,600.00	947,350.00
IC2209	中证 500 期货 IC2209 合约	3.00	3,818,400.00	173,280.00
合计	-	-	-	1,120,630.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,120,630.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	235,693.95
其中：交易所市场	235,693.95
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
应付指数使用费	693,790.98
应退替代款	209,357.31
合计	1,233,061.79

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	223,015,418.00	223,015,418.00
本期申购	44,000,000.00	44,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-82,000,000.00	-82,000,000.00
本期末	185,015,418.00	185,015,418.00

6.4.7.8 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
本期期初	292,183,872.44	-97,270,623.03	194,913,249.41
本期利润	-13,344,671.36	-23,982,769.25	-37,327,440.61
本期基金份额交易产生的变动数	-48,823,622.68	24,716,463.36	-24,107,159.32

其中：基金申购款	56,517,760.65	-28,196,966.44	28,320,794.21
基金赎回款	-105,341,383.33	52,913,429.80	-52,427,953.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	230,015,578.40	-96,536,928.92	133,478,649.48

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,464.50
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	34,024.05
其他	412.65
合计	61,901.20

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,282,681.27
股票投资收益——赎回差价收入	-3,717,150.91
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	-10,999,832.18

## 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	92,955,176.64
减：卖出股票成本总额	100,045,550.68
减：交易费用	192,307.23
买卖股票差价收入	-7,282,681.27

## 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	134,427,953.53
减：现金支付赎回款总额	55,685,103.53

减：赎回股票成本总额	82,460,000.91
减：交易费用	-
赎回差价收入	-3,717,150.91

## 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.11 债券投资收益

## 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	45.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	43,395.90
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	43,440.93

## 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,922.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	160,500.00
减：应计利息总额	24.41
减：交易费用	1.75
买卖债券差价收入	43,395.90

## 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.13 衍生工具收益

## 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。



## 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-4,066,277.97

## 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,699,804.31
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	2,699,804.31

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-25,406,499.25
——股票投资	-25,415,702.77
——债券投资	9,203.52
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,423,730.00
——权证投资	-
——期货投资	1,423,730.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-23,982,769.25

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益	68,716.05
合计	68,716.05

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,461.15
指数使用费	58,190.53
合计	154,871.23

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	-	-	361,743,086.67	76.44%

## 6.4.10.1.2 权证交易

无。

## 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	-	-	1,531,072.29	94.79%

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	-	-	2,500,000.00	100.00%

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	156,023.84	76.44%	63,940.44	28.27%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	831,293.62	1,890,791.04
其中：支付销售机构的客户维护费	13,500.89	14,311.70

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	166,258.71	378,158.25

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
-	-	-	-	-

上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	3,941,300.00	2,628.83	-	-

注：无。

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限 (单位：天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限 (单位：天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	2021012100000471	红日药业	2021-01-21	44,100.00	10,000.00	14	3.60	61.74	-	-
中信证券	2021020400013575	红日药业	2021-02-04	38,100.00	10,000.00	14	3.60	53.34	-	-

中信 证券	2021021800043086	红日 药业	2021-02-18	40,400.00	10,000.00	14	3.50	54.99	-	-
中信 证券	2021030400034847	红日 药业	2021-03-04	41,900.00	10,000.00	14	3.30	53.77	-	-
中信 证券	2021031800037540	红日 药业	2021-03-18	40,900.00	10,000.00	14	3.40	54.08	-	-
中信 证券	2021040100030469	红日 药业	2021-04-01	40,900.00	10,000.00	14	3.50	55.67	-	-
中信 证券	2021041500032470	红日 药业	2021-04-15	39,300.00	10,000.00	14	3.50	53.49	-	-
中信 证券	2021042900023947	红日 药业	2021-04-29	40,900.00	10,000.00	14	3.50	55.67	-	-
中信 证券	2021051300027626	红日 药业	2021-05-13	45,800.00	10,000.00	14	3.50	62.34	-	-

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	60,988,100.00	32.96%	82,240,000.00	36.88%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	14,206,520.48	27,464.50	7,244,128.74	14,283.54

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	53,108	265,540.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	2,569	196,682.64
中信证券	301302	华如科技	新股发行	2,801	145,736.03
中信证券	301109	军信股份	新股发行	4,103	142,825.43
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	1,138	137,698.00
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	600905	三峡能源	网下申购	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	688819	天能股份	网下申购	13,552	566,338.08
中信证券	688660	电气风电	网下申购	44,065	239,713.60
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10
中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28

注：本期“网上申购”和“网下申购”两种发行方式合并披露为“新股发行”。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 46,284,520.00 元（上年度可比期间：130,769,080.00 元），支付给中信期货的佣金为 1,133.97 元（上年度可比期间为：3,203.85 元）。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 1,855,005.72 元，占基金资产净值的比例为 0.58%（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 2,460,883.80 元，占基金资产净值的比例为 0.59%）。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中国银行而被动）持有的中国银行股票估值



总额为人民币 803,916.00 元，占基金资产净值的比例为 0.25%（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 936,960.00 元，占基金资产净值的比例为 0.22%）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600938	中国海油	2022-04-14	6 个月	新发流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
301139	元道通信	2022-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	38.46	38.46	3,305	127,110.30	127,110.30	-
688125	安达智能	2022-04-08	6 个月	新发流通受限	60.55	43.43	2,893	175,171.15	125,642.99	-
688150	莱特光电	2022-03-10	6 个月	新发流通受限	22.05	19.60	5,626	124,053.30	110,269.60	-
688267	中触	2022-02-09	6 个月	新发	41.90	31.90	1,747	73,199.30	55,729.30	-

	媒			流通受限						
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	新发流通受限	50.31	70.37	293	14,740.83	20,618.41	-
301302	华如科技	2022-06-16	6 个月	新发流通受限	52.03	56.42	281	14,620.43	15,854.02	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新发流通受限	38.46	38.46	368	14,153.28	14,153.28	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月	新发流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301236	软通动力	2022-03-08	6 个月	新发流通受限	72.88	31.38	437	21,208.08	13,713.06	含证券送配
301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新发流通受限	76.56	51.92	257	19,675.92	13,343.44	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6 个月	新发流通	42.50	32.02	402	13,132.50	12,872.04	含证券送

				受限						配
301259	艾布鲁	2022-04-18	6 个月	新发流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	新发流通受限	109.30	45.69	263	19,127.50	12,016.47	含 证 券 送 配
301097	天益医疗	2022-03-25	6 个月	新发流通受限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6 个月	新发流通受限	39.88	31.09	381	15,194.28	11,845.29	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6 个月	新发流通受限	39.07	29.87	378	14,768.46	11,290.86	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6 个月	新发流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6 个月	新发流通受限	56.69	41.86	253	14,342.57	10,590.58	-

301109	军信股份	2022-04-06	6 个月	新发 流通 受限	34.81	16.14	617	14,306.91	9,958.38	含 证 券 送 配
301150	中一科技	2022-04-14	6 个月	新发 流通 受限	163.56	82.76	120	13,084.80	9,931.20	含 证 券 送 配
301123	奕东电子	2022-01-14	6 个月	新发 流通 受限	37.23	25.39	386	14,370.78	9,800.54	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6 个月	新发 流通 受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	新发 流通 受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	新发 流通 受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新发 流通 受限	173.98	87.82	101	9,742.88	8,869.82	含 证 券 送 配
301148	嘉戎	2022-04-14	6 个月	新发	38.39	23.90	348	13,359.72	8,317.20	-

	技术			流通受限						
301181	标榜股份	2022-02-11	6 个月	新发流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6 个月	新发流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	新发流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6 个月	新发流通受限	64.08	37.52	174	11,149.92	6,528.48	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022-06-14	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	500	50,000.00	50,003.73	期末估值单价为含息

										价格
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	----

注：①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。本基金所认购非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

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

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

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理

架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回

申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	300,084,293.11	94.22	392,457,768.55	93.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	99,326.46	0.03	7,000.00	0.00
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	300,183,619.57	94.25	392,464,768.55	93.91

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除 MSCI 中国 A 股国际通指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-15,167,358.94	-19,310,638.02
	+5%	15,167,358.94	19,310,638.02

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	298,144,936.55
第二层次	141,263.58
第三层次	1,897,419.44
合计	300,183,619.57

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金

融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	300,084,293.11	93.26
	其中：股票	300,084,293.11	93.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	99,326.46	0.03
	其中：债券	99,326.46	0.03
	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	18,320,662.77	5.69
8	其他各项资产	3,267,234.94	1.02
9	合计	321,771,517.28	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	3,625,029.24	1.14
B	采矿业	12,863,041.96	4.04
C	制造业	177,605,024.77	55.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,940,364.10	2.81
E	建筑业	5,454,139.84	1.71
F	批发和零售业	2,805,909.87	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	9,113,951.94	2.86
H	住宿和餐饮业	598,480.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,224,831.68	2.90
J	金融业	52,472,519.43	16.48

K	房地产业	5,284,971.68	1.66
L	租赁和商务服务业	4,222,786.97	1.33
M	科学研究和技术服务业	3,509,935.64	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	668,649.71	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,535,562.48	0.80
R	文化、体育和娱乐业	914,924.80	0.29
S	综合	244,169.00	0.08
	合计	300,084,293.11	94.22

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	8,874	18,147,330.00	5.70
2	300750	宁德时代	16,400	8,757,600.00	2.75
3	600036	招商银行	144,752	6,108,534.40	1.92
4	000858	五粮液	27,329	5,518,544.97	1.73
5	002594	比亚迪	12,690	4,231,988.10	1.33
6	600900	长江电力	159,646	3,691,015.52	1.16
7	601318	中国平安	76,040	3,550,307.60	1.11
8	601012	隆基绿能	53,134	3,540,318.42	1.11
9	601888	中国中免	13,636	3,176,233.48	1.00
10	601166	兴业银行	145,716	2,899,748.40	0.91
11	600809	山西汾酒	8,574	2,784,835.20	0.87
12	300760	迈瑞医疗	8,500	2,662,200.00	0.84
13	000568	泸州老窖	10,329	2,546,511.66	0.80
14	603288	海天味业	27,170	2,455,081.20	0.77
15	300059	东方财富	92,714	2,354,935.60	0.74
16	600309	万华化学	22,000	2,133,780.00	0.67
17	601398	工商银行	441,500	2,105,955.00	0.66
18	000001	平安银行	136,188	2,040,096.24	0.64
19	002714	牧原股份	36,860	2,037,252.20	0.64
20	002304	洋河股份	10,633	1,947,433.95	0.61
21	002352	顺丰控股	34,400	1,919,864.00	0.60
22	600438	通威股份	31,600	1,891,576.00	0.59
23	603259	药明康德	18,028	1,874,731.72	0.59
24	600030	中信证券	85,642	1,855,005.72	0.58
25	601288	农业银行	597,500	1,804,450.00	0.57
26	600887	伊利股份	44,916	1,749,478.20	0.55
27	300015	爱尔眼科	37,884	1,696,066.68	0.53
28	002475	立讯精密	49,683	1,678,788.57	0.53

29	002142	宁波银行	46,399	1,661,548.19	0.52
30	600276	恒瑞医药	44,695	1,657,737.55	0.52
31	600000	浦发银行	206,048	1,650,444.48	0.52
32	601668	中国建筑	294,227	1,565,287.64	0.49
33	002812	恩捷股份	6,200	1,552,790.00	0.49
34	601088	中国神华	46,252	1,540,191.60	0.48
35	600436	片仔癀	4,291	1,530,728.43	0.48
36	600048	保利发展	83,960	1,465,941.60	0.46
37	601816	京沪高铁	287,200	1,441,744.00	0.45
38	601225	陕西煤业	67,969	1,439,583.42	0.45
39	000002	万科 A	68,189	1,397,874.50	0.44
40	601328	交通银行	275,500	1,371,990.00	0.43
41	601899	紫金矿业	144,600	1,349,118.00	0.42
42	002129	TCL 中环	22,700	1,336,803.00	0.42
43	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.42
44	300014	亿纬锂能	13,273	1,294,117.50	0.41
45	600406	国电南瑞	47,011	1,269,297.00	0.40
46	600905	三峡能源	200,500	1,261,145.00	0.40
47	300122	智飞生物	11,300	1,254,413.00	0.39
48	002459	晶澳科技	15,760	1,243,464.00	0.39
49	601919	中远海控	88,850	1,235,015.00	0.39
50	300124	汇川技术	18,500	1,218,595.00	0.38
51	600690	海尔智家	44,268	1,215,599.28	0.38
52	002460	赣锋锂业	8,057	1,198,075.90	0.38
53	600031	三一重工	59,559	1,135,194.54	0.36
54	601601	中国太保	48,042	1,130,428.26	0.35
55	002493	荣盛石化	71,025	1,093,074.75	0.34
56	603799	华友钴业	11,203	1,071,230.86	0.34
57	603501	韦尔股份	6,100	1,055,483.00	0.33
58	000725	京东方 A	263,150	1,036,811.00	0.33
59	002371	北方华创	3,700	1,025,344.00	0.32
60	300274	阳光电源	10,300	1,011,975.00	0.32
61	000625	长安汽车	58,121	1,006,655.72	0.32
62	601658	邮储银行	186,600	1,005,774.00	0.32
63	600585	海螺水泥	28,070	990,309.60	0.31
64	688599	天合光能	15,133	987,428.25	0.31
65	600104	上汽集团	54,662	973,530.22	0.31
66	300498	温氏股份	44,576	949,023.04	0.30
67	600019	宝钢股份	156,206	940,360.12	0.30
68	600016	民生银行	248,824	925,625.28	0.29
69	600346	恒力石化	41,240	917,177.60	0.29
70	600028	中国石化	223,500	911,880.00	0.29
71	600111	北方稀土	25,527	897,529.32	0.28

72	601766	中国中车	170,700	887,640.00	0.28
73	601390	中国中铁	144,170	885,203.80	0.28
74	601066	中信建投	30,400	878,864.00	0.28
75	601818	光大银行	290,200	873,502.00	0.27
76	601985	中国核电	126,200	865,732.00	0.27
77	600893	航发动力	18,772	854,313.72	0.27
78	601669	中国电建	107,300	844,451.00	0.27
79	002709	天赐材料	13,520	839,051.20	0.26
80	603659	璞泰来	9,780	825,432.00	0.26
81	002049	紫光国微	4,300	815,796.00	0.26
82	002241	歌尔股份	24,020	807,072.00	0.25
83	601988	中国银行	246,600	803,916.00	0.25
84	601857	中国石油	151,500	802,950.00	0.25
85	601211	国泰君安	52,700	801,040.00	0.25
86	300896	爱美客	1,300	780,013.00	0.24
87	000776	广发证券	41,600	777,920.00	0.24
88	000538	云南白药	12,528	756,565.92	0.24
89	600050	中国联通	217,400	752,204.00	0.24
90	600010	包钢股份	319,906	751,779.10	0.24
91	600999	招商证券	52,097	750,717.77	0.24
92	600745	闻泰科技	8,800	748,968.00	0.24
93	001979	招商蛇口	55,661	747,527.23	0.23
94	600919	江苏银行	103,671	738,137.52	0.23
95	601688	华泰证券	51,700	734,140.00	0.23
96	601009	南京银行	70,250	732,005.00	0.23
97	600089	特变电工	26,610	728,847.90	0.23
98	000596	古井贡酒	2,900	724,014.00	0.23
99	000895	双汇发展	24,350	713,455.00	0.22
100	000063	中兴通讯	27,900	712,287.00	0.22
101	603993	洛阳钼业	124,000	710,520.00	0.22
102	600188	兖矿能源	17,800	702,744.00	0.22
103	002311	海大集团	11,700	702,117.00	0.22
104	000651	格力电器	20,700	698,004.00	0.22
105	601006	大秦铁路	104,400	687,996.00	0.22
106	601138	工业富联	69,700	685,848.00	0.22
107	002027	分众传媒	101,340	682,018.20	0.21
108	000166	申万宏源	158,141	678,424.89	0.21
109	000661	长春高新	2,900	676,918.00	0.21
110	601169	北京银行	148,362	673,563.48	0.21
111	002230	科大讯飞	16,311	672,339.42	0.21
112	300759	康龙化成	7,050	671,301.00	0.21
113	600837	海通证券	67,736	664,490.16	0.21
114	603986	兆易创新	4,600	654,166.00	0.21

115	601229	上海银行	99,661	652,779.55	0.20
116	603392	万泰生物	4,160	646,048.00	0.20
117	688111	金山办公	3,217	634,135.04	0.20
118	600989	宝丰能源	42,800	627,020.00	0.20
119	600926	杭州银行	41,620	623,467.60	0.20
120	600196	复星医药	14,121	622,594.89	0.20
121	603806	福斯特	9,372	614,053.44	0.19
122	300316	晶盛机电	9,038	610,878.42	0.19
123	601628	中国人寿	19,560	607,924.80	0.19
124	600150	中国船舶	31,400	595,972.00	0.19
125	000338	潍柴动力	47,600	593,572.00	0.19
126	600660	福耀玻璃	14,000	585,340.00	0.18
127	601633	长城汽车	15,800	585,232.00	0.18
128	300751	迈为股份	1,180	579,262.00	0.18
129	002920	德赛西威	3,900	577,200.00	0.18
130	601100	恒立液压	9,220	569,058.40	0.18
131	600029	南方航空	77,700	567,987.00	0.18
132	600522	中天科技	24,000	554,400.00	0.17
133	300763	锦浪科技	2,600	553,800.00	0.17
134	000963	华东医药	12,189	550,455.24	0.17
135	300999	金龙鱼	10,180	549,923.60	0.17
136	600886	国投电力	52,276	548,898.00	0.17
137	600958	东方证券	53,556	546,806.76	0.17
138	601111	中国国航	46,600	541,026.00	0.17
139	601877	正泰电器	15,120	540,993.60	0.17
140	601868	中国能建	227,700	539,649.00	0.17
141	300142	沃森生物	11,117	537,951.63	0.17
142	603833	欧派家居	3,560	536,420.80	0.17
143	002074	国轩高科	11,600	528,960.00	0.17
144	601689	拓普集团	7,700	526,911.00	0.17
145	601238	广汽集团	34,500	525,780.00	0.17
146	600588	用友网络	24,075	522,668.25	0.16
147	600460	士兰微	10,000	520,000.00	0.16
148	600600	青岛啤酒	4,986	518,145.12	0.16
149	300782	卓胜微	3,808	514,080.00	0.16
150	688012	中微公司	4,368	509,964.00	0.16
151	600741	华域汽车	22,083	507,909.00	0.16
152	000733	振华科技	3,700	503,089.00	0.16
153	002180	纳思达	9,900	501,138.00	0.16
154	601615	明阳智能	14,800	500,240.00	0.16
155	600132	重庆啤酒	3,400	498,440.00	0.16
156	002001	新和成	21,652	493,882.12	0.16
157	600233	圆通速递	24,100	491,399.00	0.15

158	002821	凯莱英	1,700	491,300.00	0.15
159	300769	德方纳米	1,200	490,416.00	0.15
160	600795	国电电力	125,200	489,532.00	0.15
161	600176	中国巨石	28,023	487,880.43	0.15
162	600256	广汇能源	46,100	485,894.00	0.15
163	300628	亿联网络	6,350	483,552.50	0.15
164	000876	新希望	31,600	483,480.00	0.15
165	000100	TCL 科技	99,600	477,084.00	0.15
166	688008	澜起科技	7,841	475,007.78	0.15
167	000301	东方盛虹	27,900	471,789.00	0.15
168	600547	山东黄金	25,363	470,737.28	0.15
169	601336	新华保险	14,600	469,974.00	0.15
170	600015	华夏银行	89,948	468,629.08	0.15
171	603290	斯达半导	1,200	463,080.00	0.15
172	300661	圣邦股份	2,512	457,234.24	0.14
173	601865	福莱特	11,900	453,390.00	0.14
174	600011	华能国际	64,300	452,672.00	0.14
175	688396	华润微	7,619	450,054.33	0.14
176	603369	今世缘	8,800	448,800.00	0.14
177	600570	恒生电子	10,281	447,634.74	0.14
178	600884	杉杉股份	15,000	445,800.00	0.14
179	002756	永兴材料	2,900	441,409.00	0.14
180	601618	中国中冶	125,242	438,347.00	0.14
181	300413	芒果超媒	13,130	438,016.80	0.14
182	002648	卫星化学	16,926	437,537.10	0.14
183	601600	中国铝业	91,900	436,525.00	0.14
184	600845	宝信软件	7,980	435,708.00	0.14
185	300957	贝泰妮	2,000	435,060.00	0.14
186	601788	光大证券	27,500	433,400.00	0.14
187	600426	华鲁恒升	14,764	431,108.80	0.14
188	002736	国信证券	44,995	430,602.15	0.14
189	601360	三六零	50,180	427,533.60	0.13
190	000799	酒鬼酒	2,300	427,363.00	0.13
191	600383	金地集团	31,674	425,698.56	0.13
192	603260	合盛硅业	3,600	424,656.00	0.13
193	688036	传音控股	4,752	424,020.96	0.13
194	603185	上机数控	2,700	421,173.00	0.13
195	601838	成都银行	25,400	421,132.00	0.13
196	603486	科沃斯	3,400	414,426.00	0.13
197	002938	鹏鼎控股	13,600	410,856.00	0.13
198	000786	北新建材	11,800	408,516.00	0.13
199	601939	建设银行	67,347	408,122.82	0.13
200	688005	容百科技	3,121	403,982.24	0.13

201	300408	三环集团	13,420	403,942.00	0.13
202	601117	中国化学	42,900	403,689.00	0.13
203	601155	新城控股	15,863	403,396.09	0.13
204	600754	锦江酒店	6,400	402,560.00	0.13
205	600763	通策医疗	2,300	401,212.00	0.13
206	605117	德业股份	1,400	391,846.00	0.12
207	300496	中科创达	2,997	391,048.56	0.12
208	601916	浙商银行	117,300	389,436.00	0.12
209	000938	紫光股份	19,995	387,903.00	0.12
210	601901	方正证券	57,700	387,167.00	0.12
211	300433	蓝思科技	34,800	385,236.00	0.12
212	000983	山西焦煤	28,668	383,864.52	0.12
213	600009	上海机场	6,749	382,668.30	0.12
214	300207	欣旺达	12,100	382,360.00	0.12
215	600018	上港集团	65,400	381,282.00	0.12
216	000069	华侨城 A	57,550	373,499.50	0.12
217	688180	君实生物	4,926	371,124.84	0.12
218	601727	上海电气	89,600	368,256.00	0.12
219	002240	盛新锂能	6,100	368,196.00	0.12
220	603606	东方电缆	4,800	367,680.00	0.12
221	601995	中金公司	8,251	367,086.99	0.12
222	300390	天华超净	4,200	367,080.00	0.12
223	000723	美锦能源	30,000	366,000.00	0.11
224	300033	同花顺	3,800	365,370.00	0.11
225	603899	晨光股份	6,500	364,520.00	0.11
226	688126	沪硅产业	15,845	364,118.10	0.11
227	300223	北京君正	3,400	361,250.00	0.11
228	300919	中伟股份	2,900	359,310.00	0.11
229	002202	金风科技	24,184	357,923.20	0.11
230	601607	上海医药	19,566	353,753.28	0.11
231	600039	四川路桥	33,500	352,755.00	0.11
232	603345	安井食品	2,100	352,527.00	0.11
233	603737	三棵树	2,720	352,049.60	0.11
234	600115	中国东航	64,076	351,777.24	0.11
235	300601	康泰生物	7,740	349,693.20	0.11
236	002120	韵达股份	20,340	347,000.40	0.11
237	002841	视源股份	4,600	346,472.00	0.11
238	300450	先导智能	5,480	346,226.40	0.11
239	002916	深南电路	3,680	344,852.80	0.11
240	002236	大华股份	20,950	343,999.00	0.11
241	600141	兴发集团	7,800	343,122.00	0.11
242	601799	星宇股份	2,000	342,000.00	0.11
243	300595	欧普康视	5,921	338,621.99	0.11



244	002013	中航机电	27,200	335,920.00	0.11
245	002601	龙佰集团	16,700	334,835.00	0.11
246	600584	长电科技	12,400	334,800.00	0.11
247	601377	兴业证券	47,000	331,350.00	0.10
248	603816	顾家家居	5,850	331,285.50	0.10
249	002555	三七互娱	15,600	331,188.00	0.10
250	600563	法拉电子	1,600	328,256.00	0.10
251	300073	当升科技	3,600	325,224.00	0.10
252	688363	华熙生物	2,287	325,165.66	0.10
253	600779	水井坊	3,500	323,890.00	0.10
254	002080	中材科技	11,730	322,575.00	0.10
255	600875	东方电气	19,500	320,775.00	0.10
256	605358	立昂微	4,700	316,686.00	0.10
257	600332	白云山	9,937	313,909.83	0.10
258	603613	国联股份	3,525	312,315.00	0.10
259	600918	中泰证券	40,800	312,120.00	0.10
260	300454	深信服	3,000	311,340.00	0.10
261	000999	华润三九	6,900	310,500.00	0.10
262	600803	新奥股份	16,700	310,453.00	0.10
263	601878	浙商证券	27,200	309,536.00	0.10
264	600219	南山铝业	83,800	309,222.00	0.10
265	600674	川投能源	25,764	307,106.88	0.10
266	000157	中联重科	49,800	306,768.00	0.10
267	603568	伟明环保	9,190	306,670.30	0.10
268	601699	潞安环能	20,960	306,435.20	0.10
269	002340	格林美	33,600	305,760.00	0.10
270	600885	宏发股份	7,280	304,668.00	0.10
271	300347	泰格医药	2,650	303,292.50	0.10
272	603456	九洲药业	5,800	299,860.00	0.09
273	603198	迎驾贡酒	4,600	299,644.00	0.09
274	688122	西部超导	3,240	298,728.00	0.09
275	002791	坚朗五金	2,300	298,356.00	0.09
276	002176	江特电机	11,900	297,976.00	0.09
277	000425	徐工机械	55,000	296,450.00	0.09
278	002738	中矿资源	3,200	296,352.00	0.09
279	002414	高德红外	23,019	296,254.53	0.09
280	688099	晶晨股份	2,931	296,031.00	0.09
281	002064	华峰化学	34,900	294,556.00	0.09
282	600486	扬农化工	2,200	293,216.00	0.09
283	002007	华兰生物	12,790	291,612.00	0.09
284	601881	中国银河	30,100	291,067.00	0.09
285	601216	君正集团	59,200	288,896.00	0.09
286	300529	健帆生物	5,650	287,528.50	0.09

287	000519	中兵红箭	9,800	285,670.00	0.09
288	600061	国投资本	44,892	285,513.12	0.09
289	002603	以岭药业	11,640	282,852.00	0.09
290	600298	安琪酵母	5,800	282,750.00	0.09
291	300144	宋城演艺	18,360	281,826.00	0.09
292	002252	上海莱士	47,300	280,489.00	0.09
293	600392	盛和资源	12,300	277,980.00	0.09
294	002192	融捷股份	1,800	276,660.00	0.09
295	600183	生益科技	16,200	275,238.00	0.09
296	002384	东山精密	12,000	275,160.00	0.09
297	300037	新宙邦	5,200	273,312.00	0.09
298	600499	科达制造	13,200	272,448.00	0.09
299	603882	金域医学	3,300	272,415.00	0.09
300	601933	永辉超市	63,400	271,352.00	0.09
301	000683	远兴能源	25,800	271,158.00	0.09
302	000977	浪潮信息	10,240	271,155.20	0.09
303	000703	恒逸石化	25,750	270,632.50	0.08
304	002850	科达利	1,700	270,300.00	0.08
305	002353	杰瑞股份	6,700	270,010.00	0.08
306	002372	伟星新材	11,200	269,248.00	0.08
307	688187	时代电气	4,130	268,408.70	0.08
308	601233	桐昆股份	16,900	268,372.00	0.08
309	603939	益丰药房	5,038	266,157.54	0.08
310	002497	雅化集团	8,100	264,465.00	0.08
311	601966	玲珑轮胎	10,415	264,228.55	0.08
312	603077	和邦生物	62,000	264,120.00	0.08
313	600153	建发股份	20,035	261,857.45	0.08
314	600348	华阳股份	16,900	261,274.00	0.08
315	002625	光启技术	15,100	260,777.00	0.08
316	600362	江西铜业	14,564	259,676.12	0.08
317	002407	多氟多	5,300	259,223.00	0.08
318	000738	航发控制	9,200	258,520.00	0.08
319	601108	财通证券	32,800	258,136.00	0.08
320	601696	中银证券	19,400	258,020.00	0.08
321	300146	汤臣倍健	11,900	257,635.00	0.08
322	600655	豫园股份	27,229	257,041.76	0.08
323	300373	扬杰科技	3,600	256,500.00	0.08
324	603127	昭衍新药	2,240	254,912.00	0.08
325	603517	绝味食品	4,400	254,408.00	0.08
326	600985	淮北矿业	17,400	253,344.00	0.08
327	002268	卫士通	5,900	253,169.00	0.08
328	601319	中国人保	49,900	252,494.00	0.08
329	002602	世纪华通	52,380	252,471.60	0.08

330	603589	口子窖	4,300	252,023.00	0.08
331	002405	四维图新	16,700	251,669.00	0.08
332	600026	中远海能	24,300	251,019.00	0.08
333	600160	巨化股份	19,000	249,850.00	0.08
334	688169	石头科技	404	249,146.80	0.08
335	002600	领益智造	49,600	248,992.00	0.08
336	000932	华菱钢铁	48,500	246,865.00	0.08
337	603707	健友股份	8,698	245,283.60	0.08
338	000066	中国长城	22,600	244,532.00	0.08
339	000009	中国宝安	18,100	244,169.00	0.08
340	601555	东吴证券	35,195	243,901.35	0.08
341	601058	赛轮轮胎	21,500	242,305.00	0.08
342	600487	亨通光电	16,600	241,364.00	0.08
343	000630	铜陵有色	73,890	240,881.40	0.08
344	000807	云铝股份	24,300	240,084.00	0.08
345	601636	旗滨集团	18,800	239,700.00	0.08
346	002508	老板电器	6,598	237,725.94	0.07
347	600521	华海药业	10,460	237,442.00	0.07
348	600109	国金证券	26,200	235,800.00	0.07
349	600606	绿地控股	59,440	235,382.40	0.07
350	300568	星源材质	8,091	234,962.64	0.07
351	600161	天坛生物	9,660	234,544.80	0.07
352	300003	乐普医疗	12,600	233,982.00	0.07
353	002078	太阳纸业	18,900	232,659.00	0.07
354	600352	浙江龙盛	22,700	231,086.00	0.07
355	000155	川能动力	10,400	230,360.00	0.07
356	000783	长江证券	38,834	230,285.62	0.07
357	000830	鲁西化工	13,300	229,957.00	0.07
358	601077	渝农商行	62,100	229,770.00	0.07
359	000629	攀钢钒钛	60,400	229,520.00	0.07
360	603267	鸿远电子	1,700	228,361.00	0.07
361	688009	中国通号	50,383	228,234.99	0.07
362	688188	柏楚电子	1,037	228,181.48	0.07
363	600848	上海临港	16,820	228,079.20	0.07
364	002385	大北农	29,077	227,091.37	0.07
365	601577	长沙银行	28,300	224,419.00	0.07
366	600027	华电国际	57,100	224,403.00	0.07
367	300724	捷佳伟创	2,500	223,375.00	0.07
368	002568	百润股份	7,420	222,896.80	0.07
369	601666	平煤股份	16,300	221,517.00	0.07
370	002294	信立泰	7,865	221,006.50	0.07
371	000825	太钢不锈	40,000	218,000.00	0.07
372	300699	光威复材	3,700	217,819.00	0.07

373	600705	中航产融	62,636	216,720.56	0.07
374	600549	厦门钨业	10,000	216,200.00	0.07
375	601990	南京证券	25,900	216,006.00	0.07
376	002430	杭氧股份	6,900	215,694.00	0.07
377	000831	五矿稀土	6,900	215,625.00	0.07
378	600177	雅戈尔	32,500	215,475.00	0.07
379	002507	涪陵榨菜	6,238	215,335.76	0.07
380	600415	小商品城	38,500	214,445.00	0.07
381	002032	苏泊尔	3,800	214,092.00	0.07
382	000027	深圳能源	33,370	213,901.70	0.07
383	300832	新产业	4,700	212,017.00	0.07
384	002185	华天科技	22,500	211,050.00	0.07
385	601866	中远海发	69,500	208,500.00	0.07
386	300850	新强联	2,340	208,330.20	0.07
387	300676	华大基因	2,900	207,930.00	0.07
388	002531	天顺风能	12,600	207,774.00	0.07
389	603658	安图生物	4,240	207,293.60	0.07
390	603233	大参林	6,616	207,080.80	0.07
391	000933	神火股份	15,800	206,664.00	0.06
392	601456	国联证券	16,800	206,136.00	0.06
393	000987	越秀金控	29,312	206,063.36	0.06
394	002557	洽洽食品	3,600	204,948.00	0.06
395	002673	西部证券	31,332	204,911.28	0.06
396	603160	汇顶科技	3,300	204,369.00	0.06
397	000800	一汽解放	21,800	203,612.00	0.06
398	600516	方大炭素	26,633	202,410.80	0.06
399	601198	东兴证券	22,700	202,030.00	0.06
400	600315	上海家化	4,700	200,925.00	0.06
401	002326	永太科技	6,100	200,873.00	0.06
402	000960	锡业股份	11,800	197,886.00	0.06
403	601168	西部矿业	16,700	197,561.00	0.06
404	688006	杭可科技	2,808	196,728.48	0.06
405	000401	冀东水泥	18,700	196,724.00	0.06
406	002463	沪电股份	13,302	196,337.52	0.06
407	600258	首旅酒店	7,900	195,920.00	0.06
408	002624	完美世界	13,600	195,432.00	0.06
409	300251	光线传媒	20,600	195,082.00	0.06
410	002153	石基信息	12,265	194,645.55	0.06
411	603444	吉比特	500	194,000.00	0.06
412	600872	中炬高新	5,600	193,816.00	0.06
413	002128	电投能源	13,500	193,320.00	0.06
414	300357	我武生物	3,713	193,187.39	0.06
415	601162	天风证券	60,600	192,708.00	0.06

416	000728	国元证券	30,660	190,705.20	0.06
417	688202	美迪西	560	190,181.60	0.06
418	000975	银泰黄金	19,520	190,124.80	0.06
419	600038	中直股份	4,200	189,840.00	0.06
420	600170	上海建工	62,500	189,375.00	0.06
421	002797	第一创业	29,500	189,095.00	0.06
422	002028	思源电气	5,300	188,998.00	0.06
423	002409	雅克科技	3,400	188,734.00	0.06
424	002422	科伦药业	10,044	187,822.80	0.06
425	600801	华新水泥	9,600	187,296.00	0.06
426	601880	辽港股份	110,100	187,170.00	0.06
427	600704	物产中大	36,400	186,732.00	0.06
428	600988	赤峰黄金	11,700	186,615.00	0.06
429	000937	冀中能源	24,800	185,008.00	0.06
430	600369	西南证券	46,600	185,002.00	0.06
431	002939	长城证券	18,200	184,912.00	0.06
432	600079	人福医药	11,500	184,000.00	0.06
433	600338	西藏珠峰	6,400	183,680.00	0.06
434	600598	北大荒	12,400	183,024.00	0.06
435	300558	贝达药业	3,000	182,400.00	0.06
436	000893	亚钾国际	5,300	182,373.00	0.06
437	603338	浙江鼎力	3,582	181,607.40	0.06
438	002266	浙富控股	37,700	180,583.00	0.06
439	002223	鱼跃医疗	7,000	179,620.00	0.06
440	002532	天山铝业	27,200	177,616.00	0.06
441	300726	宏达电子	2,900	177,393.00	0.06
442	000591	太阳能	21,100	176,185.00	0.06
443	300308	中际旭创	5,604	174,004.20	0.05
444	688185	康希诺	870	173,199.60	0.05
445	603218	日月股份	6,800	172,720.00	0.05
446	000050	深天马 A	17,300	172,481.00	0.05
447	600143	金发科技	18,100	172,312.00	0.05
448	603605	珀莱雅	1,043	172,282.74	0.05
449	000739	普洛药业	8,300	171,312.00	0.05
450	603712	七一二	5,400	170,100.00	0.05
451	002030	达安基因	9,832	169,012.08	0.05
452	601016	节能风电	35,200	168,960.00	0.05
453	000709	河钢股份	74,523	168,421.98	0.05
454	000423	东阿阿胶	4,534	167,531.30	0.05
455	002299	圣农发展	8,700	166,866.00	0.05
456	600380	健康元	13,400	165,490.00	0.05
457	002541	鸿路钢构	4,940	164,996.00	0.05
458	600688	上海石化	51,500	163,770.00	0.05

459	601992	金隅集团	58,602	162,327.54	0.05
460	002152	广电运通	17,500	162,225.00	0.05
461	000988	华工科技	7,000	162,190.00	0.05
462	002408	齐翔腾达	19,900	161,389.00	0.05
463	000513	丽珠集团	4,400	159,324.00	0.05
464	600808	马钢股份	41,900	158,801.00	0.05
465	603858	步长制药	8,027	158,212.17	0.05
466	600056	中国医药	10,540	156,202.80	0.05
467	600998	九州通	13,100	156,021.00	0.05
468	603866	桃李面包	9,388	155,371.40	0.05
469	000998	隆平高科	9,300	154,938.00	0.05
470	002456	欧菲光	22,910	153,726.10	0.05
471	002044	美年健康	27,468	152,996.76	0.05
472	002506	协鑫集成	41,100	152,892.00	0.05
473	002138	顺络电子	5,600	152,600.00	0.05
474	600699	均胜电子	9,579	150,486.09	0.05
475	600295	鄂尔多斯	8,300	149,815.00	0.05
476	600711	盛屯矿业	19,200	148,992.00	0.05
477	002145	中核钛白	20,895	148,981.35	0.05
478	002465	海格通信	16,148	146,785.32	0.05
479	002926	华西证券	18,500	145,040.00	0.05
480	002500	山西证券	25,180	144,533.20	0.05
481	002156	通富微电	9,300	143,220.00	0.04
482	002065	东华软件	22,466	141,985.12	0.04
483	301139	元道通信	3,673	141,263.58	0.04
484	002092	中泰化学	18,100	140,456.00	0.04
485	000860	顺鑫农业	5,200	139,464.00	0.04
486	600511	国药股份	5,200	139,256.00	0.04
487	000750	国海证券	38,200	138,666.00	0.04
488	002010	传化智联	21,500	138,245.00	0.04
489	688298	东方生物	1,198	136,751.70	0.04
490	600895	张江高科	10,900	135,705.00	0.04
491	300418	昆仑万维	8,419	134,704.00	0.04
492	002157	正邦科技	22,100	133,926.00	0.04
493	300070	碧水源	25,500	132,855.00	0.04
494	300253	卫宁健康	15,010	131,787.80	0.04
495	300383	光环新网	12,600	131,292.00	0.04
496	002558	巨人网络	14,200	129,930.00	0.04
497	002958	青农商行	39,000	129,480.00	0.04
498	600583	海油工程	31,018	128,724.70	0.04
499	688125	安达智能	2,893	125,642.99	0.04
500	688002	睿创微纳	3,100	123,132.00	0.04
501	600498	烽火通信	8,300	120,184.00	0.04

502	601598	中国外运	30,800	119,504.00	0.04
503	300677	英科医疗	4,680	118,684.80	0.04
504	002925	盈趣科技	5,450	117,284.00	0.04
505	000686	东北证券	16,400	114,636.00	0.04
506	002563	森马服饰	18,900	111,888.00	0.04
507	688150	莱特光电	5,626	110,269.60	0.03
508	000656	金科股份	37,500	107,250.00	0.03
509	688267	中触媒	1,747	55,729.30	0.02
510	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
511	301122	采纳股份	293	20,618.41	0.01
512	301127	天源环保	1,637	18,219.81	0.01
513	301302	华如科技	281	15,854.02	0.00
514	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
515	301236	软通动力	437	13,713.06	0.00
516	301200	大族数控	257	13,343.44	0.00
517	301103	何氏眼科	402	12,872.04	0.00
518	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
519	301206	三元生物	263	12,016.47	0.00
520	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
521	301102	兆讯传媒	381	11,845.29	0.00
522	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
523	301248	杰创智能	378	11,290.86	0.00
524	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
525	301237	和顺科技	253	10,590.58	0.00
526	301109	军信股份	617	9,958.38	0.00
527	301150	中一科技	120	9,931.20	0.00
528	301123	奕东电子	386	9,800.54	0.00
529	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
530	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
531	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
532	301219	腾远钴业	101	8,869.82	0.00
533	301148	嘉戎技术	348	8,317.20	0.00
534	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
535	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
536	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
537	301196	唯科科技	174	6,528.48	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	2,428,865.00	0.58

2	600905	三峡能源	1,710,509.00	0.41
3	688599	天合光能	1,364,322.69	0.33
4	000858	五粮液	1,351,403.00	0.32
5	600938	中国海油	1,296,054.00	0.31
6	002371	北方华创	1,072,419.00	0.26
7	000651	格力电器	1,003,179.00	0.24
8	601006	大秦铁路	848,970.00	0.20
9	002594	比亚迪	797,753.00	0.19
10	300760	迈瑞医疗	753,518.00	0.18
11	002049	紫光国微	741,826.00	0.18
12	601868	中国能建	736,965.00	0.18
13	600519	贵州茅台	725,985.00	0.17
14	002812	恩捷股份	696,768.00	0.17
15	688396	华润微	679,043.51	0.16
16	300059	东方财富	663,019.00	0.16
17	000001	平安银行	584,798.00	0.14
18	688005	容百科技	556,913.78	0.13
19	601238	广汽集团	554,878.00	0.13
20	002475	立讯精密	549,222.00	0.13

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	4,452,092.00	1.07
2	000858	五粮液	2,459,127.00	0.59
3	002594	比亚迪	1,593,607.00	0.38
4	300760	迈瑞医疗	1,380,716.00	0.33
5	002371	北方华创	1,304,056.00	0.31
6	000001	平安银行	1,085,846.61	0.26
7	600519	贵州茅台	1,076,016.00	0.26
8	002812	恩捷股份	1,060,634.00	0.25
9	002714	牧原股份	1,057,660.00	0.25
10	300059	东方财富	1,005,367.11	0.24
11	000568	泸州老窖	1,003,848.00	0.24
12	002475	立讯精密	989,280.00	0.24
13	002352	顺丰控股	980,604.00	0.23
14	002049	紫光国微	937,306.00	0.22
15	002142	宁波银行	888,583.70	0.21
16	002304	洋河股份	799,651.00	0.19
17	300122	智飞生物	696,240.00	0.17
18	000002	万科 A	683,947.00	0.16



19	002050	三花智控	675,758.65	0.16
20	300015	爱尔眼科	642,554.00	0.15

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	73,918,806.92
卖出股票收入（成交）总额	92,955,176.64

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	99,326.46	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	99,326.46	0.03

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113060	浙 22 转债	500	50,003.73	0.02
2	127061	美锦转债	250	29,691.84	0.01
3	123145	药石转债	81	11,321.15	0.00
4	113644	艾迪转债	70	8,309.74	0.00
5	-	-	-	-	-

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，招商银行、兴业银行系标的指数成份股，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。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,172,560.17
2	应收清算款	1,094,674.77
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,267,234.94

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,043	60,800.33	34,017,389.00	18.39%	90,009,929.00	48.65%	60,988,100.00	32.96%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	竞技世界（北京）网络技术有限公司	16,711,700.00	9.03%
2	上海浦东发展银行股份有限公司—兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF）	4,125,500.00	2.23%
3	兴业银行股份有限公司—兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	4,096,400.00	2.21%
4	张星	2,189,400.00	1.18%
5	广发证券股份有限公司	2,111,842.00	1.14%
6	国泰君安证券股份有限公司	1,709,635.00	0.92%
7	安英慧	1,461,700.00	0.79%
8	陈文峰	1,211,600.00	0.65%
9	张兆玮	1,150,000.00	0.62%
10	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险	1,090,900.00	0.59%

	产品		
11	中国银行股份有限公司— 华夏 MSCI 中国 A 股国际 通交易型开放式指数证券 投资基金联接基金	60,988,100.00	32.96%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 9 月 17 日）基金份额总额	602,503,247.00
本报告期期初基金份额总额	223,015,418.00
本报告期基金总申购份额	44,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	82,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	185,015,418.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	39,013,819.44	24.66%	16,827.35	24.67%	-
国信证券	3	23,897,389.15	15.11%	10,307.01	15.11%	-
华泰证券	3	21,941,215.94	13.87%	9,463.36	13.87%	-
方正证券	4	19,416,154.36	12.28%	8,374.40	12.28%	-
国盛证券	2	13,999,949.79	8.85%	6,038.47	8.85%	-
招商证券	4	13,009,367.60	8.22%	5,610.60	8.22%	-
海通证券	5	11,503,548.52	7.27%	4,961.77	7.27%	-
中信建投证券	4	7,258,908.71	4.59%	3,130.96	4.59%	-
中金公司	4	3,550,138.50	2.24%	1,531.26	2.24%	-
申万宏源证券	4	2,374,453.00	1.50%	1,024.17	1.50%	-
银河证券	7	2,210,771.96	1.40%	953.59	1.40%	-

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。

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 有较强的全方位金融服务能力和水平：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；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、广发证券、国金证券、国泰君安证券、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、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际、野村东方国际证券、中国银河证券、中信建投证券、中信证券、中信证券(浙江)、中银国际证券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，华泰证券的部分交易单元、粤开证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	10,816.64	5.30%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	25,027.40	12.27%	-	-	-	-	-	-
方正证券	8,960.40	4.39%	-	-	-	-	-	-
国盛证券	28,836.62	14.14%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河	130,281.00	63.89%	-	-	-	-	-	-

证券								
----	--	--	--	--	--	--	--	--

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-12
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	2022-02-17
4	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	2022-02-19
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	2022-02-23
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	2022-03-12
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	2022-03-19
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	2022-04-08
9	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	2022-04-13
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	2022-04-16
11	华夏基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-16
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	2022-06-18
13	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
14	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	1	2022-01-01 至 2022-06-30	82,240,000.00	5,205,000.00	26,456,900.00	60,988,100.00	32.96%
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>							

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金转型的文件；
- 2、《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日