

**华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式  
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金	
基金简称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数	
基金主代码	007505	
交易代码	007505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 7 月 16 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	86,318,299.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
下属分级基金的交易代码	007505	007506
报告期末下属分级基金的份额总额	34,561,434.55 份	51,756,865.36 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略等。
业绩比较基准	中证华夏 AH 经济蓝筹股票指数收益率×95%+中国人民银行公布的人民币活期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于中高风险品种。 基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	秦一楠
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市东城区建国门内大街69号

办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	杨明辉	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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	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）	
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
本期已实现收益	186,998.72	209,257.34
本期利润	-2,439,312.11	-3,984,610.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0675	-0.0760
本期加权平均净值利润率	-5.24%	-5.96%
本期基金份额净值增长率	-5.46%	-5.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
期末可供分配利润	10,117,337.92	14,559,550.40
期末可供分配基金份额利润	0.2927	0.2813
期末基金资产净值	44,678,772.47	66,316,415.76
期末基金份额净值	1.2927	1.2813
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
基金份额累计净值增长率	29.27%	28.13%

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

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.13%	0.82%	2.24%	0.79%	0.89%	0.03%
过去三个月	2.73%	1.28%	1.51%	1.23%	1.22%	0.05%
过去六个月	-5.46%	1.46%	-7.18%	1.47%	1.72%	-0.01%
过去一年	-6.76%	1.23%	-11.62%	1.25%	4.86%	-0.02%
自基金合同生效起至今	29.27%	1.19%	11.08%	1.18%	18.19%	0.01%

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.11%	0.82%	2.24%	0.79%	0.87%	0.03%
过去三个月	2.65%	1.28%	1.51%	1.23%	1.14%	0.05%
过去六个月	-5.59%	1.46%	-7.18%	1.47%	1.59%	-0.01%
过去一年	-7.04%	1.23%	-11.62%	1.25%	4.58%	-0.02%
自基金合同生效起至今	28.13%	1.19%	11.08%	1.18%	17.05%	0.01%

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

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

##### 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

(2019 年 7 月 16 日至 2022 年 6 月 30 日)

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A



华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C



## §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		
荣膺	本基金的基金经理、投委会成员	2020-12-08	-	12 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20

					<p>日至 2018 年 9 月 16 日期间)、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理 (2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、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经理 (2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、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经理 (2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理 (2018 年 11 月 14 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理 (2019 年 6 月 26 日至 2021 年 10 月 21 日期间)等。</p>
--	--	--	--	--	---

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 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华夏中证 AH 经济蓝筹指数，基金业绩比较基准为：中证华夏 AH 经济蓝筹股票指数收益率  $\times 95\%$  + 人民币活期存款利率  $\times 5\%$ 。中证华夏 AH 经济蓝筹股票指数从沪深 A 股以及符合港股通资格的港股中分行业选取一定数量财务基本面良好的蓝筹股票作为指数成份股，行业权重根据各行业对国民经济的贡献度进行分配，行业内个股根据财务基本面综合得分加权，以综合反映国民经济产业结构变迁及发展趋势。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，国内疫情一度遭遇反复，常态化核酸检测似乎是目前平衡疫情防控和经济发展的有效手段，国内就业压力较大，房地产行业下行。货币和信用持续保持宽松，积极的财政政策和各种产业政策托底经济，房地产继续因城施策、保持定力，鼓励平台经济健康发展。

海外通胀压力加大，欧美央行纷纷加息，欧元区负利率债券大面积消失，全球流动性成本上升，发达经济体面临以牺牲经济增长为代价对抗通胀的艰难处境。

市场方面，上半年 A 股经历过过山车，背后的经济周期是内在下行动力，积极的财政和货币政策是反弹上行动力，市场筹码结构的变化加大了波动幅度。市场贝塔的大幅波动，使得宽基 ETF 在抄底时的工具化优势得以显现。结构方面，下跌阶段低估值行业表现出相对收益，反弹阶段新能源赛道表现出弹性。市场主线依旧是围绕能源行业，代表旧能源的煤炭、石油表现优异，代表新能源的新能源车、光伏、风电、储能备受追捧。港股方面，风险偏好最低的阶段已经过去，无论是互联网、创新药还是低估值红利，都具备了长期配置吸引力。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 份额净值为 1.2927 元，本报告期份额净值增长率为-5.46%，同期业绩比较基准增长率-7.18%，本报告期跟踪偏离度为+1.72%；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 份额净值为 1.2813 元，本报告期份额净值增长率为-5.59%，同期业绩比较基准增长率-7.18%，本报告期跟踪偏离度为+1.59%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济处于衰退象限向复苏象限转换的阶段，财政和货币政策依旧对宏观经济有利，通胀不会成为掣肘货币政策的因素；欧美处于加息抑制通胀的阶段，经济周期逐步向衰退转化，因此我国在相对有利的周期位置上，全球视角下的人民币资产具备相对吸引力。如果发生以下风险，将会提供非常好的长期配置机会，譬如美联储缩表对全球流动性显现出负面影响，海外经济衰退预期加剧引发国内出口担忧。内因是事物变化的根据，外因是事物变化的条件。未来一旦国内经济迈入复苏象限，很可能意味着市场新一轮上升周期的开始。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所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。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公

司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# §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：华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

报告截止日：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	7,300,676.89	10,506,235.77
结算备付金		130,456.98	51,529.32
存出保证金		16,049.33	66,179.50
交易性金融资产	6.4.7.2	103,606,245.97	120,077,514.43
其中：股票投资		103,606,245.97	120,071,914.43
基金投资		-	-
债券投资		-	5,600.00
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		-	72,522.16

应收股利		363,308.99	17,477.40
应收申购款		54,301.38	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,889.88
资产总计		111,471,039.54	130,794,348.46
<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		6.48	7.33
应付赎回款		268,885.87	-
应付管理人报酬		44,986.44	69,442.37
应付托管费		8,997.30	13,888.47
应付销售服务费		16,130.56	21,673.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	136,844.66	267,302.15
负债合计		475,851.31	372,313.32
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	86,318,299.91	95,793,132.77
未分配利润	6.4.7.8	24,676,888.32	34,628,902.37
净资产合计		110,995,188.23	130,422,035.14
负债和净资产总计		111,471,039.54	130,794,348.46

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 基金份额净值 1.2927 元，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 基金份额净值 1.2813 元；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数基金份额总额 86,318,299.91 份（其中 A 类 34,561,434.55 份，C 类 51,756,865.36 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：华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

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>		-5,876,451.64	8,558,003.52
1.利息收入		30,611.40	33,144.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	30,611.40	33,075.41
债券利息收入		-	69.52
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）		908,160.62	7,249,224.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-512,626.33	6,178,259.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	15,701.64	3,857.44
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	-	-205,260.00
股利收益	6.4.7.14	1,405,085.31	1,272,367.97
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	-6,820,178.48	1,185,423.55
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	4,954.82	90,210.19
<b>减：二、营业总支出</b>		547,470.78	686,495.64
1.管理人报酬		282,302.87	279,494.70
2.托管费		56,460.57	55,898.90
3.销售服务费		99,631.61	112,530.79
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		0.03	0.03
8.其他费用	6.4.7.18	109,075.70	238,571.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-6,423,922.42	7,871,507.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-6,423,922.42	7,871,507.88
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-6,423,922.42	7,871,507.88

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：华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

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）	95,793,132.77	-	34,628,902.37	130,422,035.14
二、本期期初净资产（基金净值）	95,793,132.77	-	34,628,902.37	130,422,035.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,474,832.86	-	-9,952,014.05	-19,426,846.91
（一）、综合收益总额	-	-	-6,423,922.42	-6,423,922.42
（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）	-9,474,832.86	-	-3,528,091.63	-13,002,924.49
其中：1.基金申购款	14,852,524.32	-	4,257,026.55	19,109,550.87
2.基金赎回款	-24,327,357.18	-	-7,785,118.18	-32,112,475.36
（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）	86,318,299.91	-	24,676,888.32	110,995,188.23
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	未分配利润	净资产合计



		收益（若有）		
一、上期期末净资产（基金净值）	83,250,997.15	-	23,211,279.88	106,462,277.03
二、本期期初净资产（基金净值）	83,250,997.15	-	23,211,279.88	106,462,277.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	67,019,342.06	-	34,151,565.12	101,170,907.18
（一）、综合收益总额	-	-	7,871,507.88	7,871,507.88
（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）	67,019,342.06	-	26,280,057.24	93,299,399.30
其中：1.基金申购款	119,411,956.97	-	44,871,544.11	164,283,501.08
2.基金赎回款	-52,392,614.91	-	-18,591,486.87	-70,984,101.78
（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）	150,270,339.21	-	57,362,845.00	207,633,184.21

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

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]938 号《关于准予华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2019 年 6 月 3 日至 2019 年 7 月 12 日共募集 124,317,926.68 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2019）验字第

60739337\_A55 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 7 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 124,384,327.63 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,400.95 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券以及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权、货币市场工具(含同业存单)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

#### 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》的规定和相关法律法规的要求,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、应收证券清算款和应收股利，金额分别为 10,506,235.77 元、51,529.32 元、66,179.50 元、2,889.88 元、72,522.16 元和 17,477.40 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、应收清算款和应收股利，金额分别为 10,508,593.71 元、52,045.16 元、66,194.90 元、0.00 元、72,522.16 元和 17,477.40 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 120,077,514.43 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 120,077,515.13 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 7.33 元、69,442.37 元、13,888.47 元、21,673.00 元、87,302.15 元和 180,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、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 7.33 元、69,442.37 元、13,888.47 元、21,673.00 元、87,302.15 元和 180,000.00 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	7,300,676.89
等于：本金	7,299,181.60
加：应计利息	1,495.29
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	7,300,676.89

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	115,351,284.35	-	103,606,245.97	-11,745,038.38
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	115,351,284.35	-	103,606,245.97	-11,745,038.38

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

无。

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	8.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	32,533.63
其中：交易所市场	32,533.63
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	20,000.00
合计	136,844.66

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	40,891,801.09	40,891,801.09
本期申购	4,130,017.66	4,130,017.66
本期赎回（以“-”号填列）	-10,460,384.20	-10,460,384.20
本期末	34,561,434.55	34,561,434.55

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	54,901,331.68	54,901,331.68
本期申购	10,722,506.66	10,722,506.66
本期赎回（以“-”号填列）	-13,866,972.98	-13,866,972.98
本期末	51,756,865.36	51,756,865.36

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	12,635,546.26	2,382,841.85	15,018,388.11
本期利润	186,998.72	-2,626,310.83	-2,439,312.11
本期基金份额交易产生的变动数	-1,932,157.28	-529,580.80	-2,461,738.08
其中：基金申购款	1,255,715.20	-7,889.62	1,247,825.58
基金赎回款	-3,187,872.48	-521,691.18	-3,709,563.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,890,387.70	-773,049.78	10,117,337.92

##### 华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	16,404,056.11	3,206,458.15	19,610,514.26

本期利润	209,257.34	-4,193,867.65	-3,984,610.31
本期基金份额交易产生的变动数	-933,984.97	-132,368.58	-1,066,353.55
其中：基金申购款	3,146,865.62	-137,664.65	3,009,200.97
基金赎回款	-4,080,850.59	5,296.07	-4,075,554.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,679,328.48	-1,119,778.08	14,559,550.40

## 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	28,914.68
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	1,417.35
其他	279.37
合计	30,611.40

## 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	36,243,290.80
减：卖出股票成本总额	36,670,826.11
减：交易费用	85,091.02
买卖股票差价收入	-512,626.33

## 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	15.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,686.39
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	15,701.64

## 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	107,704.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	92,000.00
减：应计利息总额	16.22
减：交易费用	1.45
买卖债券差价收入	15,686.39

## 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

无。

## 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	1,405,085.31
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	1,405,085.31

## 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	-6,820,178.48
——股票投资	-6,820,178.48
——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	-6,820,178.48

## 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	4,954.82
基金申购费收入	-
合计	4,954.82

## 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,571.40
指数使用费	20,000.00
证券组合费	1,201.74
合计	109,075.70

## 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

中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人股东控股的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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	4,081,710.55	6.49%	113,979,590.92	89.63%

##### 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	7,056.28	6.55%	275,764.58	72.20%

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

##### 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	1,980.37	7.00%	-	-
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	50,845.04	90.17%	47,061.17	77.12%
------	-----------	--------	-----------	--------

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	282,302.87	279,494.70
其中：支付销售机构的客户维护费	77,278.58	89,871.21

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	56,460.57	55,898.90

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。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服 务费的各关 联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
华夏中证 AH 经济蓝 筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	合计	

华夏基金管理 有限公司	-	16,792.94	16,792.94
中信证券	-	137.45	137.45
华夏财富	-	43.27	43.27
中信证券 (华南)	-	-	-
合计	-	16,973.66	16,973.66
获得销售服 务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 AH 经济蓝 筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	合计
华夏基金管 理有限公司	-	4,311.13	4,311.13
中信证券	-	133.37	133.37
华夏财富	-	14.05	14.05
中信证券 (华南)	-	6.70	6.70
合计	-	4,465.25	4,465.25

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 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

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

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

份额单位：份

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
----	----------------------------	---------------------------------

	华夏中证AH经济蓝筹股票指数A	华夏中证AH经济蓝筹股票指数C	华夏中证AH经济蓝筹股票指数A	华夏中证AH经济蓝筹股票指数C
期初持有的基金份额	10,002,444.69	-	10,002,444.69	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,002,444.69	-	10,002,444.69	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.94%	-	15.81%	-

## 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

无。

## 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
中国农业银行活期存款	7,300,676.89	28,914.68	23,883,334.41	28,206.51

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

## 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	3,000	32,400.00
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	603132	金徽股份	新股发行	1,177	12,711.60
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	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
中信证券	688425	铁建重工	网上申购	500	1,435.00

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的中信证券股票估值总额为人民币 471,971.40 元，占基金资产净值的比例为 0.43%（2021 年 12 月 31 日，本基金持有的中信证券股票估值总额为人民币 562,533.00 元，占基金资产净值的比例为 0.43%）。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的农业银行股票估值总额为人民币 357,870.00 元，占基金资产净值的比例为 0.32%（2021 年 12 月 31 日，本基金持有的农业银行股票估值总额为人民币 332,514.00 元，占基金资产净值的比例为 0.25%）。

#### 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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
01333	中国忠旺	2021-08-30	重大事项	1.44	-	-	48,800	81,764.25	70,111.89	-

##### 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之内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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



回规律相匹配。

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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融	-	29,237,454.20	-	29,237,454.20

资产				
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	13,707.44	202,477.60	-	216,185.04
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	13,707.44	29,439,931.80	-	29,453,639.24
项目	上年度末			
	2021年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	32,882,946.48	-	32,882,946.48
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	17,477.40	-	17,477.40
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	32,900,423.88	-	32,900,423.88
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

## 6.4.13.4.2.2 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	上年度末

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
港币相对人民币升值 5%	1,480,038.16	1,645,021.19
港币相对人民币贬值 5%	-1,480,038.16	-1,645,021.19

#### 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	103,606,245.97	93.34	120,071,914.43	92.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	5,600.00	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	103,606,245.97	93.34	120,077,514.43	92.07

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	除中证华夏 AH 经济蓝筹股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-5,410,402.05	-5,472,309.44
+5%	5,410,402.05	5,472,309.44	

#### 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	103,536,134.08
第二层次	70,111.89
第三层次	-
合计	103,606,245.97

##### 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、境内证券涨跌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	103,606,245.97	92.94
	其中：股票	103,606,245.97	92.94
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	7,431,133.87	6.67
8	其他各项资产	433,659.70	0.39
9	合计	111,471,039.54	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 29,237,454.20 元，占基金资产净值比例为 26.34%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,674,104.50	4.21
B	采矿业	3,187,118.00	2.87
C	制造业	26,737,979.49	24.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,543,354.00	1.39
E	建筑业	7,725,336.09	6.96
F	批发和零售业	8,336,003.12	7.51
G	交通运输、仓储和邮政业	2,146,341.19	1.93
H	住宿和餐饮业	144,670.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,769,603.78	4.30
J	金融业	8,382,785.14	7.55
K	房地产业	3,455,735.00	3.11
L	租赁和商务服务业	2,636,482.20	2.38
M	科学研究和技术服务业	313,996.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	224,342.20	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	57,216.06	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	33,725.00	0.03
	合计	74,368,791.77	67.00

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------

通讯服务	10,695,587.67	9.64
非必需消费品	5,017,580.58	4.52
房地产	2,945,860.17	2.65
保健	2,126,761.76	1.92
必需消费品	1,909,771.83	1.72
材料	1,807,092.58	1.63
信息技术	1,698,005.39	1.53
工业	1,460,007.75	1.32
公用事业	1,000,901.53	0.90
能源	575,884.94	0.52
金融	-	-
合计	29,237,454.20	26.34

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	00700	腾讯控股	33,500	10,153,157.76	9.15
2	002714	牧原股份	50,800	2,807,716.00	2.53
3	601939	建设银行	423,300	2,565,198.00	2.31
4	601888	中国中免	8,600	2,003,198.00	1.80
5	601668	中国建筑	296,100	1,575,252.00	1.42
6	000002	万科 A	75,400	1,545,700.00	1.39
7	600941	中国移动	24,600	1,488,300.00	1.34
8	03690	美团-W	8,700	1,444,877.71	1.30
9	601390	中国中铁	231,500	1,421,410.00	1.28
10	01109	华润置地	42,000	1,314,598.07	1.18
11	601318	中国平安	28,000	1,307,320.00	1.18
12	601186	中国铁建	154,100	1,217,390.00	1.10
13	03323	中国建材	150,000	1,074,973.83	0.97
14	06110	滔搏	167,000	1,018,283.28	0.92
15	06808	高鑫零售	460,000	1,003,137.87	0.90
16	600028	中国石化	240,500	981,240.00	0.88
17	600827	百联股份	71,900	949,799.00	0.86
18	601919	中远海控	67,050	931,995.00	0.84
19	002311	海大集团	15,400	924,154.00	0.83
20	601669	中国电建	114,800	903,476.00	0.81
21	600019	宝钢股份	147,161	885,909.22	0.80
22	600036	招商银行	20,500	865,100.00	0.78
23	000034	神州数码	56,196	855,303.12	0.77
24	600519	贵州茅台	400	818,000.00	0.74

25	01099	国药控股	48,000	780,754.26	0.70
26	600048	保利发展	42,000	733,320.00	0.66
27	601618	中国中冶	201,900	706,650.00	0.64
28	002091	江苏国泰	62,800	675,100.00	0.61
29	600104	上汽集团	37,300	664,313.00	0.60
30	002299	圣农发展	31,800	609,924.00	0.55
31	600859	王府井	23,400	607,932.00	0.55
32	002416	爱施德	65,000	604,500.00	0.54
33	00883	中国海洋石油	65,000	575,884.94	0.52
34	601398	工商银行	120,300	573,831.00	0.52
35	601800	中国交建	60,200	558,656.00	0.50
36	000829	天音控股	46,800	557,388.00	0.50
37	00788	中国铁塔	628,000	542,429.91	0.49
38	00688	中国海外发展	25,000	530,217.80	0.48
39	600325	华发股份	68,100	515,517.00	0.46
40	601857	中国石油	95,600	506,680.00	0.46
41	000501	武商集团	45,400	503,940.00	0.45
42	02007	碧桂园	121,000	502,903.03	0.45
43	000725	京东方 A	126,100	496,834.00	0.45
44	600153	建发股份	38,000	496,660.00	0.45
45	688981	中芯国际	10,788	487,293.96	0.44
46	600585	海螺水泥	13,800	486,864.00	0.44
47	000930	中粮科技	53,400	482,736.00	0.43
48	600606	绿地控股	120,980	479,080.80	0.43
49	600030	中信证券	21,790	471,971.40	0.43
50	000932	华菱钢铁	92,300	469,807.00	0.42
51	600887	伊利股份	12,000	467,400.00	0.42
52	000333	美的集团	7,700	465,003.00	0.42
53	601899	紫金矿业	49,400	460,902.00	0.42
54	600309	万华化学	4,700	455,853.00	0.41
55	600729	重庆百货	20,000	431,400.00	0.39
56	01958	北京汽车	190,000	424,088.72	0.38
57	000858	五粮液	2,100	424,053.00	0.38
58	002594	比亚迪	1,200	400,188.00	0.36
59	601868	中国能建	165,317	391,801.29	0.35
60	601600	中国铝业	81,300	386,175.00	0.35
61	01810	小米集团-W	32,000	373,273.33	0.34
62	600837	海通证券	37,400	366,894.00	0.33
63	601088	中国神华	11,000	366,300.00	0.33
64	600704	物产中大	70,600	362,178.00	0.33
65	001979	招商蛇口	26,700	358,581.00	0.32
66	601288	农业银行	118,500	357,870.00	0.32
67	600900	长江电力	15,400	356,048.00	0.32

68	000338	潍柴动力	27,400	341,678.00	0.31
69	00493	国美零售	1,046,000	339,920.92	0.31
70	00696	中国民航信息网络	26,000	338,860.49	0.31
71	02319	蒙牛乳业	10,000	334,806.89	0.30
72	00960	龙湖集团	10,500	332,690.29	0.30
73	600737	中粮糖业	43,800	329,376.00	0.30
74	300750	宁德时代	600	320,400.00	0.29
75	002419	天虹股份	44,100	314,433.00	0.28
76	300226	上海钢联	13,864	314,019.60	0.28
77	02331	李宁	5,000	310,861.57	0.28
78	601155	新城控股	11,900	302,617.00	0.27
79	00354	中国软件国际	44,000	302,155.73	0.27
80	002230	科大讯飞	7,300	300,906.00	0.27
81	02020	安踏体育	3,600	296,785.14	0.27
82	03320	华润医药	64,000	291,722.41	0.26
83	000100	TCL 科技	60,800	291,232.00	0.26
84	00992	联想集团	46,000	288,352.96	0.26
85	000998	隆平高科	17,300	288,218.00	0.26
86	601988	中国银行	88,200	287,532.00	0.26
87	600362	江西铜业	16,100	287,063.00	0.26
88	000651	格力电器	8,500	286,620.00	0.26
89	000709	河钢股份	126,300	285,438.00	0.26
90	002352	顺丰控股	5,100	284,631.00	0.26
91	600201	生物股份	30,900	283,044.00	0.26
92	601225	陕西煤业	13,300	281,694.00	0.25
93	601766	中国中车	53,400	277,680.00	0.25
94	000625	长安汽车	15,890	275,214.80	0.25
95	600010	包钢股份	115,900	272,365.00	0.25
96	600755	厦门国贸	35,700	267,750.00	0.24
97	01030	新城发展	80,000	265,450.98	0.24
98	601985	中国核电	38,300	262,738.00	0.24
99	600271	航天信息	23,800	260,372.00	0.23
100	600690	海尔智家	9,400	258,124.00	0.23
101	600346	恒力石化	11,500	255,760.00	0.23
102	01177	中国生物制药	60,000	255,017.66	0.23
103	600170	上海建工	83,600	253,308.00	0.23
104	600276	恒瑞医药	6,764	250,876.76	0.23
105	00656	复星国际	40,000	248,005.10	0.22
106	000039	中集集团	17,900	247,915.00	0.22
107	600031	三一重工	12,800	243,968.00	0.22
108	600089	特变电工	8,900	243,771.00	0.22
109	01093	石药集团	36,000	239,829.48	0.22



110	601816	京沪高铁	47,600	238,952.00	0.22
111	00489	东风集团股份	46,000	234,458.89	0.21
112	600022	山东钢铁	133,900	232,986.00	0.21
113	600057	厦门象屿	26,500	232,935.00	0.21
114	002493	荣盛石化	15,050	231,619.50	0.21
115	01378	中国宏桥	30,500	231,358.83	0.21
116	00322	康师傅控股	20,000	229,875.07	0.21
117	00175	吉利汽车	15,000	228,848.84	0.21
118	000063	中兴通讯	8,900	227,217.00	0.20
119	601688	华泰证券	15,900	225,780.00	0.20
120	600808	马钢股份	58,600	222,094.00	0.20
121	601006	大秦铁路	33,700	222,083.00	0.20
122	02688	新奥能源	2,000	220,467.98	0.20
123	601117	中国化学	23,200	218,312.00	0.20
124	601012	隆基绿能	3,116	207,619.08	0.19
125	601211	国泰君安	13,600	206,720.00	0.19
126	601658	邮储银行	38,300	206,437.00	0.19
127	00267	中信股份	30,000	203,962.82	0.18
128	601118	海南橡胶	41,100	196,458.00	0.18
129	000898	鞍钢股份	60,700	195,454.00	0.18
130	603259	药明康德	1,800	187,182.00	0.17
131	002092	中泰化学	24,100	187,016.00	0.17
132	600332	白云山	5,800	183,222.00	0.17
133	600598	北大荒	12,400	183,024.00	0.16
134	600195	中牧股份	14,800	181,448.00	0.16
135	600196	复星医药	4,100	180,769.00	0.16
136	601992	金隅集团	65,100	180,327.00	0.16
137	601360	三六零	20,900	178,068.00	0.16
138	09633	农夫山泉	4,600	177,221.02	0.16
139	600741	华域汽车	7,700	177,100.00	0.16
140	002410	广联达	3,200	174,208.00	0.16
141	003816	中国广核	62,000	173,600.00	0.16
142	002373	千方科技	15,600	173,472.00	0.16
143	000703	恒逸石化	16,450	172,889.50	0.16
144	00552	中国通信服务	58,000	171,123.52	0.15
145	600710	苏美达	28,500	168,150.00	0.15
146	601607	上海医药	9,100	164,528.00	0.15
147	600096	云天化	5,000	157,400.00	0.14
148	300383	光环新网	15,100	157,342.00	0.14
149	600299	安迪苏	16,400	157,112.00	0.14
150	600584	长电科技	5,800	156,600.00	0.14
151	02313	申洲国际	1,900	154,443.03	0.14
152	600588	用友网络	7,100	154,141.00	0.14

153	02269	药明生物	2,500	153,506.61	0.14
154	600570	恒生电子	3,500	152,390.00	0.14
155	000895	双汇发展	5,200	152,360.00	0.14
156	601898	中煤能源	14,600	151,548.00	0.14
157	601952	苏垦农发	10,800	151,092.00	0.14
158	000488	晨鸣纸业	26,700	150,588.00	0.14
159	603613	国联股份	1,695	150,177.00	0.14
160	600739	辽宁成大	10,300	150,174.00	0.14
161	603993	洛阳钼业	25,900	148,407.00	0.13
162	600352	浙江龙盛	14,300	145,574.00	0.13
163	600754	锦江酒店	2,300	144,670.00	0.13
164	00135	昆仑能源	26,000	142,970.66	0.13
165	000630	铜陵有色	43,800	142,788.00	0.13
166	00268	金蝶国际	9,000	141,619.46	0.13
167	002458	益生股份	15,100	141,487.00	0.13
168	600297	广汇汽车	53,800	140,418.00	0.13
169	000661	长春高新	600	140,052.00	0.13
170	603668	天马科技	6,800	139,332.00	0.13
171	002202	金风科技	9,400	139,120.00	0.13
172	600177	雅戈尔	20,900	138,567.00	0.12
173	600886	国投电力	13,100	137,550.00	0.12
174	601233	桐昆股份	8,600	136,568.00	0.12
175	00576	浙江沪杭甬	22,000	136,214.66	0.12
176	002746	仙坛股份	14,700	134,505.00	0.12
177	002415	海康威视	3,700	133,940.00	0.12
178	600958	东方证券	13,084	133,587.64	0.12
179	002661	克明食品	11,700	133,029.00	0.12
180	000776	广发证券	7,100	132,770.00	0.12
181	600438	通威股份	2,200	131,692.00	0.12
182	000708	中信特钢	6,450	129,967.50	0.12
183	000157	中联重科	21,000	129,360.00	0.12
184	000166	申万宏源	30,100	129,129.00	0.12
185	600718	东软集团	11,200	128,912.00	0.12
186	002304	洋河股份	700	128,205.00	0.12
187	600143	金发科技	13,400	127,568.00	0.11
188	00780	同程旅行	8,800	127,033.34	0.11
189	000963	华东医药	2,800	126,448.00	0.11
190	600426	华鲁恒升	4,280	124,976.00	0.11
191	600219	南山铝业	33,600	123,984.00	0.11
192	002212	天融信	12,200	123,830.00	0.11
193	000568	泸州老窖	500	123,270.00	0.11
194	600999	招商证券	8,510	122,629.10	0.11
195	300122	智飞生物	1,100	122,111.00	0.11

196	002475	立讯精密	3,590	121,306.10	0.11
197	600108	亚盛集团	34,400	120,400.00	0.11
198	000425	徐工机械	22,300	120,197.00	0.11
199	300119	瑞普生物	6,800	118,932.00	0.11
200	601168	西部矿业	9,800	115,934.00	0.10
201	603799	华友钴业	1,200	114,744.00	0.10
202	00384	中国燃气	11,000	114,013.93	0.10
203	000792	盐湖股份	3,800	113,848.00	0.10
204	600612	老凤祥	2,700	112,806.00	0.10
205	00836	华润电力	8,000	110,832.62	0.10
206	01044	恒安国际	3,500	110,298.13	0.10
207	002405	四维图新	7,300	110,011.00	0.10
208	600141	兴发集团	2,500	109,975.00	0.10
209	600893	航发动力	2,400	109,224.00	0.10
210	002001	新和成	4,772	108,849.32	0.10
211	000538	云南白药	1,800	108,702.00	0.10
212	00392	北京控股	4,500	107,369.10	0.10
213	600489	中金黄金	14,300	105,677.00	0.10
214	300677	英科医疗	4,140	104,990.40	0.09
215	002065	东华软件	16,500	104,280.00	0.09
216	02618	京东物流	7,100	103,950.05	0.09
217	300454	深信服	1,000	103,780.00	0.09
218	000878	云南铜业	9,100	103,649.00	0.09
219	01193	华润燃气	3,300	103,148.74	0.09
220	02689	玖龙纸业	18,000	102,212.31	0.09
221	300773	拉卡拉	5,300	101,018.00	0.09
222	002234	民和股份	6,200	98,828.00	0.09
223	601138	工业富联	9,900	97,416.00	0.09
224	000830	鲁西化工	5,600	96,824.00	0.09
225	600998	九州通	8,100	96,471.00	0.09
226	300033	同花顺	1,000	96,150.00	0.09
227	600500	中化国际	14,260	94,829.00	0.09
228	00881	中升控股	2,000	94,669.53	0.09
229	600655	豫园股份	10,000	94,400.00	0.09
230	002129	TCL 中环	1,600	94,224.00	0.08
231	300760	迈瑞医疗	300	93,960.00	0.08
232	600467	好当家	33,300	93,906.00	0.08
233	002422	科伦药业	5,000	93,500.00	0.08
234	000959	首钢股份	19,600	93,296.00	0.08
235	300012	华测检测	4,000	92,840.00	0.08
236	601866	中远海发	30,800	92,400.00	0.08
237	002439	启明星辰	4,600	91,678.00	0.08
238	00144	招商局港口	8,000	91,265.88	0.08

239	00570	中国中药	22,000	91,248.77	0.08
240	002432	九安医疗	1,500	90,090.00	0.08
241	000158	常山北明	14,900	89,400.00	0.08
242	002460	赣锋锂业	600	89,220.00	0.08
243	00152	深圳国际	13,500	89,127.90	0.08
244	03800	协鑫科技	27,000	87,511.59	0.08
245	002466	天齐锂业	700	87,360.00	0.08
246	601728	中国电信	23,200	86,536.00	0.08
247	603501	韦尔股份	500	86,515.00	0.08
248	600079	人福医药	5,400	86,400.00	0.08
249	000906	浙商中拓	9,400	85,352.00	0.08
250	002368	太极股份	4,400	84,524.00	0.08
251	00867	康哲药业	8,000	83,740.21	0.08
252	002078	太阳纸业	6,800	83,708.00	0.08
253	02314	理文造纸	29,000	83,577.72	0.08
254	601828	美凯龙	13,700	83,022.00	0.07
255	600845	宝信软件	1,500	81,900.00	0.07
256	601628	中国人寿	2,600	80,808.00	0.07
257	000960	锡业股份	4,800	80,496.00	0.07
258	01208	五矿资源	32,000	79,908.95	0.07
259	03898	时代电气	2,400	79,430.05	0.07
260	600085	同仁堂	1,500	79,320.00	0.07
261	002004	华邦健康	14,200	79,236.00	0.07
262	600536	中国软件	1,950	79,150.50	0.07
263	600803	新奥股份	4,200	78,078.00	0.07
264	601633	长城汽车	2,100	77,784.00	0.07
265	601615	明阳智能	2,300	77,740.00	0.07
266	603858	步长制药	3,940	77,657.40	0.07
267	600850	电科数字	4,130	77,065.80	0.07
268	002688	金河生物	16,200	76,950.00	0.07
269	00148	建滔集团	3,000	76,197.43	0.07
270	002601	龙佰集团	3,800	76,190.00	0.07
271	000513	丽珠集团	2,100	76,041.00	0.07
272	600380	健康元	6,100	75,335.00	0.07
273	01530	三生制药	14,000	74,709.40	0.07
274	601216	君正集团	15,100	73,688.00	0.07
275	00819	天能动力	10,000	72,605.63	0.07
276	600415	小商品城	13,000	72,410.00	0.07
277	000807	云铝股份	7,300	72,124.00	0.06
278	01313	华润水泥控股	16,000	72,109.62	0.06
279	600522	中天科技	3,100	71,610.00	0.06
280	600567	山鹰国际	25,500	70,635.00	0.06
281	600535	天士力	6,700	70,417.00	0.06

282	01333	中国忠旺	48,800	70,111.89	0.06
283	600406	国电南瑞	2,592	69,984.00	0.06
284	600008	首创环保	24,000	69,600.00	0.06
285	002183	怡亚通	9,600	69,216.00	0.06
286	02357	中航科工	18,000	69,116.46	0.06
287	601989	中国重工	18,600	69,006.00	0.06
288	002128	电投能源	4,800	68,736.00	0.06
289	601598	中国外运	17,600	68,288.00	0.06
290	603225	新凤鸣	5,900	68,086.00	0.06
291	601877	正泰电器	1,900	67,982.00	0.06
292	000555	神州信息	6,000	67,680.00	0.06
293	002185	华天科技	7,200	67,536.00	0.06
294	000401	冀东水泥	6,400	67,328.00	0.06
295	603899	晨光股份	1,200	67,296.00	0.06
296	600409	三友化工	8,200	67,158.00	0.06
297	600111	北方稀土	1,900	66,804.00	0.06
298	002156	通富微电	4,300	66,220.00	0.06
299	603300	华铁应急	8,260	65,832.20	0.06
300	01066	威高股份	8,400	65,514.40	0.06
301	600839	四川长虹	22,600	65,088.00	0.06
302	300999	金龙鱼	1,200	64,824.00	0.06
303	000027	深圳能源	10,000	64,100.00	0.06
304	02678	天虹纺织	9,000	63,882.69	0.06
305	688111	金山办公	324	63,866.88	0.06
306	03933	联邦制药	16,000	63,626.14	0.06
307	000999	华润三九	1,400	63,000.00	0.06
308	603927	中科软	2,700	62,964.00	0.06
309	06862	海底捞	4,000	62,599.91	0.06
310	000301	东方盛虹	3,700	62,567.00	0.06
311	600398	海澜之家	13,100	62,225.00	0.06
312	002648	卫星化学	2,400	62,040.00	0.06
313	600989	宝丰能源	4,200	61,530.00	0.06
314	600233	圆通速递	3,000	61,170.00	0.06
315	03808	中国重汽	6,500	61,146.09	0.06
316	06618	京东健康	1,150	60,532.49	0.05
317	600905	三峡能源	9,500	59,755.00	0.05
318	002556	辉隆股份	5,100	59,670.00	0.05
319	000938	紫光股份	3,060	59,364.00	0.05
320	00189	东岳集团	7,000	58,785.76	0.05
321	600018	上港集团	10,033	58,492.39	0.05
322	002736	国信证券	6,100	58,377.00	0.05
323	600418	江淮汽车	3,400	58,344.00	0.05
324	03998	波司登	14,000	58,306.85	0.05

325	00363	上海实业控股	6,000	58,187.13	0.05
326	688526	科前生物	2,232	58,009.68	0.05
327	002563	森马服饰	9,700	57,424.00	0.05
328	600420	国药现代	5,800	57,420.00	0.05
329	300015	爱尔眼科	1,278	57,216.06	0.05
330	001201	东瑞股份	1,480	57,098.40	0.05
331	603986	兆易创新	400	56,884.00	0.05
332	600642	申能股份	10,000	56,800.00	0.05
333	00270	粤海投资	8,000	56,784.62	0.05
334	00371	北控水务集团	28,000	56,750.41	0.05
335	600487	亨通光电	3,900	56,706.00	0.05
336	300003	乐普医疗	3,000	55,710.00	0.05
337	002064	华峰化学	6,500	54,860.00	0.05
338	601872	招商轮船	9,500	54,720.00	0.05
339	600058	五矿发展	5,300	54,272.00	0.05
340	002120	韵达股份	3,130	53,397.80	0.05
341	000652	泰达股份	13,300	53,200.00	0.05
342	601066	中信建投	1,800	52,038.00	0.05
343	600062	华润双鹤	2,000	51,320.00	0.05
344	601881	中国银河	5,300	51,251.00	0.05
345	02380	中国电力	12,000	51,106.15	0.05
346	000626	远大控股	3,900	48,984.00	0.04
347	01347	华虹半导体	2,000	48,574.79	0.04
348	002041	登海种业	2,300	48,507.00	0.04
349	000951	中国重汽	3,680	47,803.20	0.04
350	002013	中航机电	3,860	47,671.00	0.04
351	000028	国药一致	1,600	47,664.00	0.04
352	600066	宇通客车	5,500	47,575.00	0.04
353	300207	欣旺达	1,500	47,400.00	0.04
354	600623	华谊集团	5,700	47,310.00	0.04
355	600981	汇鸿集团	16,100	46,690.00	0.04
356	000921	海信家电	3,200	45,376.00	0.04
357	000078	海王生物	12,300	44,772.00	0.04
358	601319	中国人保	8,800	44,528.00	0.04
359	600966	博汇纸业	5,700	44,118.00	0.04
360	00586	海螺创业	3,000	43,871.25	0.04
361	600267	海正药业	3,400	43,554.00	0.04
362	600566	济川药业	1,600	43,456.00	0.04
363	600984	建设机械	6,660	43,156.80	0.04
364	002008	大族激光	1,300	43,069.00	0.04
365	600308	华泰股份	7,400	42,254.00	0.04
366	00968	信义光能	4,000	41,459.61	0.04
367	002459	晶澳科技	520	41,028.00	0.04

368	002340	格林美	4,500	40,950.00	0.04
369	002589	瑞康医药	10,400	40,456.00	0.04
370	600511	国药股份	1,500	40,170.00	0.04
371	002441	众业达	4,200	39,564.00	0.04
372	300124	汇川技术	600	39,522.00	0.04
373	600056	中国医药	2,660	39,421.20	0.04
374	000035	中国天楹	7,500	39,375.00	0.04
375	300274	阳光电源	400	39,300.00	0.04
376	000785	居然之家	8,700	38,715.00	0.03
377	600315	上海家化	900	38,475.00	0.03
378	002344	海宁皮城	8,200	38,294.00	0.03
379	002179	中航光电	600	37,992.00	0.03
380	600863	内蒙华电	10,400	37,960.00	0.03
381	002049	紫光国微	200	37,944.00	0.03
382	00855	中国水务	6,000	37,457.32	0.03
383	000883	湖北能源	7,300	37,303.00	0.03
384	603160	汇顶科技	600	37,158.00	0.03
385	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
386	688599	天合光能	564	36,801.00	0.03
387	600760	中航沈飞	600	36,270.00	0.03
388	600482	中国动力	2,300	36,133.00	0.03
389	600150	中国船舶	1,900	36,062.00	0.03
390	000875	吉电股份	5,100	35,445.00	0.03
391	600528	中铁工业	4,400	35,420.00	0.03
392	002701	奥瑞金	6,800	35,360.00	0.03
393	600879	航天电子	5,400	35,046.00	0.03
394	600206	有研新材	1,800	34,812.00	0.03
395	000767	晋控电力	9,300	34,689.00	0.03
396	688009	中国通号	7,596	34,409.88	0.03
397	03331	维达国际	2,000	34,378.64	0.03
398	01882	海天国际	2,000	34,293.12	0.03
399	01258	中国有色矿业	11,000	34,053.67	0.03
400	000009	中国宝安	2,500	33,725.00	0.03
401	601018	宁波港	8,500	33,150.00	0.03
402	000061	农产品	5,300	32,860.00	0.03
403	002532	天山铝业	4,900	31,997.00	0.03
404	688298	东方生物	280	31,962.00	0.03
405	002999	天禾股份	4,300	31,476.00	0.03
406	600685	中船防务	1,900	31,331.00	0.03
407	600967	内蒙一机	3,400	31,008.00	0.03
408	000800	一汽解放	3,300	30,822.00	0.03
409	601965	中国汽研	1,900	30,799.00	0.03
410	300070	碧水源	5,900	30,739.00	0.03

411	600582	天地科技	6,400	30,592.00	0.03
412	600580	卧龙电驱	2,100	30,282.00	0.03
413	603233	大参林	966	30,235.80	0.03
414	600875	东方电气	1,800	29,610.00	0.03
415	600885	宏发股份	700	29,295.00	0.03
416	300014	亿纬锂能	300	29,250.00	0.03
417	301116	益客食品	1,400	29,120.00	0.03
418	603071	物产环能	1,600	29,024.00	0.03
419	600320	振华重工	8,600	28,896.00	0.03
420	605296	神农集团	1,110	28,538.10	0.03
421	000528	柳工	4,300	27,993.00	0.03
422	00257	光大环境	7,000	27,716.71	0.02
423	002371	北方华创	100	27,712.00	0.02
424	000950	重药控股	5,500	27,500.00	0.02
425	600025	华能水电	3,900	27,261.00	0.02
426	03692	翰森制药	2,000	27,092.42	0.02
427	600236	桂冠电力	4,400	26,796.00	0.02
428	600884	杉杉股份	900	26,748.00	0.02
429	601995	中金公司	600	26,694.00	0.02
430	300888	稳健医疗	400	26,600.00	0.02
431	002831	裕同科技	900	26,595.00	0.02
432	01070	T C L 电子	8,000	25,382.04	0.02
433	002812	恩捷股份	100	25,045.00	0.02
434	002709	天赐材料	400	24,824.00	0.02
435	000550	江铃汽车	1,500	24,120.00	0.02
436	000062	深圳华强	1,800	22,860.00	0.02
437	002074	国轩高科	500	22,800.00	0.02
438	600869	远东股份	4,400	22,660.00	0.02
439	600323	瀚蓝环境	1,100	22,550.00	0.02
439	000049	德赛电池	500	22,550.00	0.02
441	000877	天山股份	1,800	22,140.00	0.02
442	600372	中航电子	1,100	21,329.00	0.02
443	600483	福能股份	1,500	21,105.00	0.02
444	600312	平高电气	2,600	20,748.00	0.02
445	000967	盈峰环境	4,100	20,746.00	0.02
446	600927	永安期货	1,000	20,170.00	0.02
447	06993	蓝月亮集团	3,500	20,054.21	0.02
448	688396	华润微	334	19,729.38	0.02
449	600377	宁沪高速	2,300	19,711.00	0.02
450	600835	上海机电	1,400	19,222.00	0.02
451	601179	中国西电	4,000	18,720.00	0.02
452	601100	恒立液压	300	18,516.00	0.02
453	000019	深粮控股	2,400	18,504.00	0.02



454	601298	青岛港	3,300	18,051.00	0.02
455	601200	上海环境	1,700	17,272.00	0.02
456	300072	三聚环保	3,400	17,204.00	0.02
457	603588	高能环境	1,440	16,603.20	0.01
458	03339	中国龙工	10,000	16,248.61	0.01
459	601106	中国一重	5,000	15,350.00	0.01
460	601139	深圳燃气	2,100	14,574.00	0.01
461	000546	金圆股份	900	14,454.00	0.01
462	03899	中集安瑞科	2,000	14,418.50	0.01
463	002430	杭氧股份	400	12,504.00	0.01
464	002717	岭南股份	4,000	12,040.00	0.01
465	00658	中国高速传动	3,000	11,929.90	0.01
466	600098	广州发展	1,900	11,894.00	0.01
467	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
468	601388	怡球资源	3,200	11,200.00	0.01
469	002034	旺能环境	500	10,265.00	0.01
470	603568	伟明环保	300	10,011.00	0.01
471	601827	三峰环境	1,400	9,968.00	0.01
472	688819	天能股份	276	9,544.08	0.01
473	000885	城发环境	1,000	9,300.00	0.01
474	000927	中国铁物	3,200	9,216.00	0.01
475	000155	川能动力	400	8,860.00	0.01
476	001289	龙源电力	400	8,704.00	0.01
477	600874	创业环保	1,200	8,076.00	0.01
478	002266	浙富控股	1,600	7,664.00	0.01
479	601865	福莱特	200	7,620.00	0.01
480	601158	重庆水务	1,400	7,490.00	0.01
481	300979	华利集团	100	7,308.00	0.01
482	002534	西子洁能	400	6,516.00	0.01
483	002573	清新环境	1,100	6,391.00	0.01
484	601330	绿色动力	800	6,264.00	0.01
485	301039	中集车辆	500	5,415.00	0.00
486	600956	新天绿能	400	4,928.00	0.00
487	003035	南网能源	500	3,175.00	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

#### 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	002714	牧原股份	2,654,422.00	2.04

2	600941	中国移动	1,625,624.00	1.25
2	00941	中国移动	229,887.02	0.18
3	00700	腾讯控股	1,410,321.39	1.08
4	000034	神州数码	875,392.37	0.67
5	01109	华润置地	608,868.33	0.47
6	002091	江苏国泰	597,486.00	0.46
7	06808	高鑫零售	513,691.88	0.39
8	600704	物产中大	363,604.00	0.28
9	002416	爱施德	361,761.00	0.28
10	01918	融创中国	318,926.59	0.24
11	06110	滔搏	313,912.11	0.24
12	000998	隆平高科	304,362.00	0.23
13	601919	中远海控	286,361.00	0.22
14	601225	陕西煤业	283,712.00	0.22
15	000829	天音控股	258,972.00	0.20
16	00696	中国民航信息网络	258,801.03	0.20
17	00354	中国软件国际	256,363.05	0.20
18	601117	中国化学	237,461.00	0.18
19	600022	山东钢铁	232,330.00	0.18
20	00656	复星国际	229,138.12	0.18

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	00700	腾讯控股	1,869,235.59	1.43
2	00941	中国移动	1,322,135.77	1.01
2	600941	中国移动	12,016.00	0.01
3	002385	大北农	1,022,110.00	0.78
4	601668	中国建筑	956,154.00	0.73
5	002251	步步高	806,943.00	0.62
6	601939	建设银行	570,493.00	0.44
7	002100	天康生物	535,671.00	0.41
8	00883	中国海洋石油	480,993.46	0.37
8	600938	中国海油	40,710.00	0.03
9	601390	中国中铁	516,274.00	0.40
10	600153	建发股份	485,857.00	0.37
11	600795	国电电力	433,490.00	0.33
12	601186	中国铁建	406,417.00	0.31
13	601669	中国电建	391,847.00	0.30
14	000002	万科 A	391,319.00	0.30
15	002127	南极电商	370,044.00	0.28

16	600827	百联股份	361,609.00	0.28
17	601888	中国中免	356,983.00	0.27
18	01918	融创中国	347,433.22	0.27
19	600337	美克家居	344,520.00	0.26
20	002697	红旗连锁	335,000.00	0.26

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	27,025,336.13
卖出股票收入（成交）总额	36,243,290.80

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 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，中国建设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，建设银行系

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	16,049.33
2	应收清算款	-
3	应收股利	363,308.99
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,301.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	433,659.70

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	1,899	18,199.81	17,591,831.30	50.90%	16,969,603.25	49.10%
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	16,299	3,175.46	6,861,077.02	13.26%	44,895,788.34	86.74%
合计	18,198	4,743.28	24,452,908.32	28.33%	61,865,391.59	71.67%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	175,066.87	0.51%
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	54,423.48	0.11%
	合计	229,490.35	0.27%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	0~10
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	0
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	0
	合计	0

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,444.69	11.59%	10,000,000.00	11.59%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,444.69	11.59%	10,000,000.00	11.59%	不少于三年

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C
基金合同生效日（2019 年 7 月 16 日）基金份额总额	44,993,831.21	79,390,496.42

本报告期期初基金份额总额	40,891,801.09	54,901,331.68
本报告期基金总申购份额	4,130,017.66	10,722,506.66
减：本报告期基金总赎回份额	10,460,384.20	13,866,972.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	34,561,434.55	51,756,865.36

## §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。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 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	
广发证券	2	42,199,549.25	67.10%	18,738.68	66.27%	-

中金公司	2	8,779,343.50	13.96%	4,166.65	14.74%	-
东方证券	1	7,831,863.71	12.45%	3,390.00	11.99%	-
中信证券	11	4,081,710.55	6.49%	1,980.37	7.00%	-

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，本基金还选择了长江证券、方正证券、高华证券、国泰君安证券、华泰证券、西部证券、招商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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

#### 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
广发证券	99,930.78	92.78%	-	-	-	-	-	-
中金公司	717.00	0.67%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	7,056.28	6.55%	-	-	-	-	-	-

#### 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华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金在 2022 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
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	2022-02-23
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	2022-03-19
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	2022-04-19
7	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
8	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

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

## §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注册的文件；
- 2、《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 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