

**华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式
证券投资基金
2023 年中期报告
2023 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：二〇二三年八月三十日

§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 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 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.....	12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54

§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	67,661,016.99 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	26,390,355.99 份	41,270,661.00 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

	院	
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

2.5 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/或基金托管人的住所/办公地址

2.6 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 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	411,989.20	526,610.05
本期利润	824,795.47	1,790,081.58
加权平均基金份额本期利润	0.0309	0.0400
本期加权平均净值利润率	2.39%	3.12%
本期基金份额净值增长率	2.35%	2.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 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	6,075,156.32	8,876,825.57
期末可供分配基金份额利润	0.2302	0.2151
期末基金资产净值	33,330,444.99	51,508,078.90
期末基金份额净值	1.2630	1.2481
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 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	26.30%	24.81%

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	2.29%	0.96%	1.65%	0.94%	0.64%	0.02%
过去三个月	-4.19%	0.85%	-4.83%	0.84%	0.64%	0.01%
过去六个月	2.35%	0.86%	1.31%	0.85%	1.04%	0.01%
过去一年	-2.30%	0.99%	-5.38%	0.99%	3.08%	0.00%
过去三年	13.55%	1.11%	-2.38%	1.11%	15.93%	0.00%
自基金合同生效起至今	26.30%	1.12%	5.10%	1.12%	21.20%	0.00%

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	2.26%	0.96%	1.65%	0.94%	0.61%	0.02%
过去三个月	-4.26%	0.85%	-4.83%	0.84%	0.57%	0.01%
过去六个月	2.19%	0.86%	1.31%	0.85%	0.88%	0.01%
过去一年	-2.59%	0.99%	-5.38%	0.99%	2.79%	0.00%
过去三年	12.53%	1.11%	-2.38%	1.11%	14.91%	0.00%
自基金合同生效起至今	24.81%	1.12%	5.10%	1.12%	19.71%	0.00%

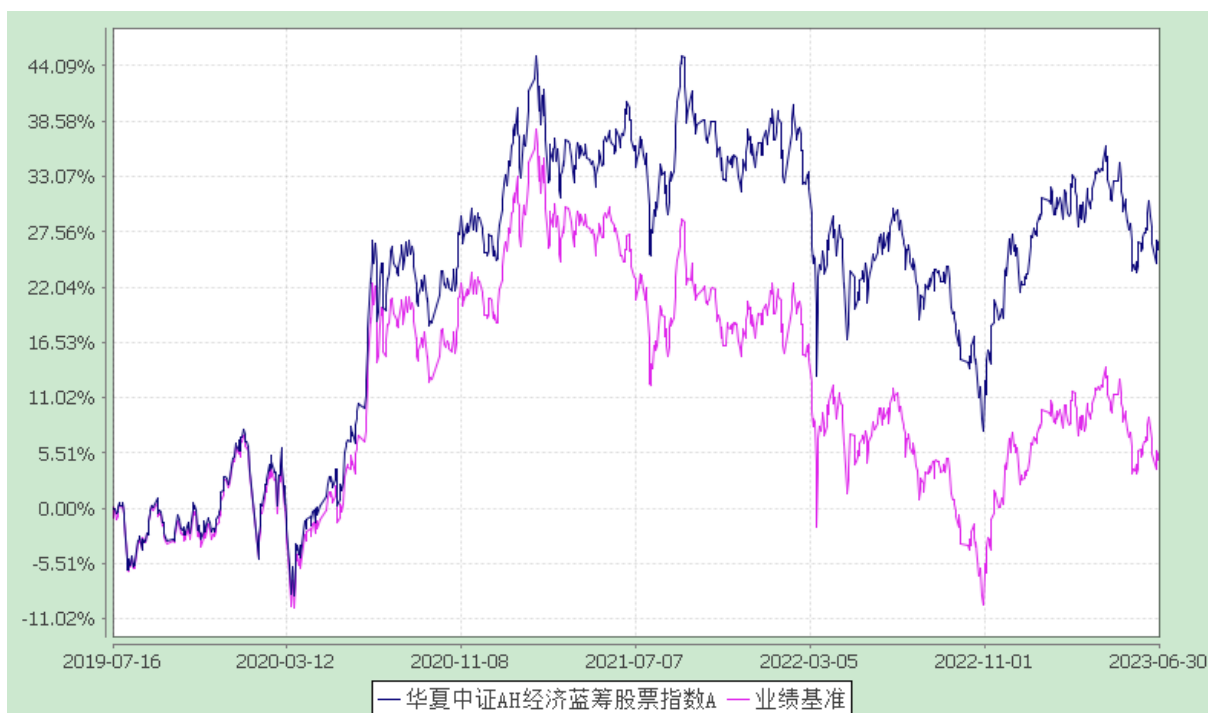
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2023 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、青岛、武汉、沈阳设有分公司,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、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题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、公募 REITs 管理人,国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司,香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、SmartBeta 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 2023 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:在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中,华夏保守养老一年持有混合(FOF)(A 类)排名第 1/59;在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中,华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22;在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中,华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 1/11;在低碳环保行业股票型基金(A 类)中,华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10;在消费行业偏股型基金(A 类)中,华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/66、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 9/66;在 QDII 混合基金(A 类)中,华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 3/43;在偏债型基金(A 类)中,华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排名前 2%(13/619)、华夏睿磐泰盛混合排名前 3%(19/619)、华夏永利一年持有混合(A 类)排名前 10%(61/619);在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中,华夏稳增混合排名前 3%(14/440)、华夏新锦绣混合(A 类)排名前 4%(18/440);在标准股票型基金(A 类)中,华夏智胜先锋股票(LOF)(A 类)排名前 4%(13/317)、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名前 6%(20/317);在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中,华夏磐利一年定开混合(A 类)排名前 5%(11/214)、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名前 10%(21/214);在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中,华夏核心制

造混合(A类)排名前 9%(126/1403)、华夏价值精选混合排名前 9%(133/1403)。

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)排名第 1/24、华夏收益债券（QDII）(A类)排名第 3/24；在短期纯债债券型基金(A类)中，华夏 30 天滚动短债债券发起式(A类)排名第 8/108；在长期纯债债券型基金(A类)中，华夏鼎隆债券(A类)排名前 6%(71/1228)、华夏鼎航债券(A类)排名前 6%(76/1228)、华夏鼎英债券(A类)排名前 7%(87/1228)；在普通债券型基金(可投转债)(A类)中，华夏鼎禄三个月定开债券(A类)排名前 9%(32/376)；在普通债券型基金(二级)(A类)中，华夏恒融债券排名前 8%(30/368)。

指数与量化产品：在增强规模指数股票型基金(A类)中，华夏中证 500 指数增强(A类)排名第 1/132、华夏中证 500 指数智选增强(A类)排名第 2/132；在主题指数股票 ETF 联接基金(A类)中，华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A类)排名第 1/110；在信用债指数债券型基金(A类)中，华夏亚债中国指数(A类)排名第 2/16；在 QDII 跨境股票 ETF 基金中，华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排名第 2/33、华夏野村日经 225ETF 排名第 7/33；在 QDII 跨境股票 ETF 联接基金(A类)中，华夏恒生 ETF 联接(A类)排名第 3/10；在主题指数股票 ETF 基金中，华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 1/313、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 6/313、华夏中证大数据产业 ETF 排名前 5%(15/313)、华夏中证文化传媒 ETF 排名前 6%(18/313)、华夏中证金融科技主题 ETF 排名前 10%(30/313)；在规模指数股票 ETF 基金中，华夏沪港通恒生 ETF 排名第 4/136；在规模指数股票 ETF 联接基金(A类)中，华夏沪港通恒生 ETF 联接(A类)排名第 4/102；在行业指数股票 ETF 联接基金(A类)中，华夏中证银行 ETF 联接(A类)排名第 6/30。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动中，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动中，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面，2023 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）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与华润银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“帮你问了 ChatGPT”、“华夏基金户口本”、“指数攻防值来啦！”、“亲子财商 36 计”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	-	13 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 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）、华夏创业板低波价 值交易型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金基金经 理（2019 年 6 月 26 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏沪 港通上证 50AH 优选指数证券

					投资基金（LOF）基金经理（2016 年 10 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019 年 6 月 26 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏饲料豆粕期货交易所开放式证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 1 月 13 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 2 月 25 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 4 月 29 日至 2022 年 8 月 22 日期间）等。
--	--	--	--	--	--

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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 90 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 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，国内先后经历需求释放以及去库存带来的需求回落，流动性充裕。权益市场赚钱难度较大，一方面，去库存阶段使然，另一方面，缺乏能够短期兑现利润的超预期产业趋势。值得一提的是 AI 方向，正在发生长期变革性的产业变化，产业链涉及硬件和软件，并可渗透至社会的各行各业。目前处于发展早期，个股波动较大。商品市场，在上半年整体经历了去库存，在二季度有企稳迹象。稳定性最高是黄金，既有全球央行储备换锚的大趋势，又可以对冲外汇风险。

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 2023 年 6 月 30 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 份额净值为 1.2630 元，本报告期份额净值增长率为 2.35%，同期业绩比较基准增长率 1.31%，本报告期跟踪偏离度为+1.04%；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 份额净值为 1.2481 元，本报告期份额净值增长率为 2.19%，同期业绩比较基准增长率 1.31%，本报告期跟踪偏离度为+0.88%。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，国内中性概率的宏观场景是库存周期见底，经济在复苏象限运行，流动性整体充裕。权益资产处于估值较低、胜率有望改善的状态，大概率继续呈现结构性轮动走势，下半年表现好于上半年的概率较大。产业趋势边际变化最大的仍然是 AI 方向，围绕产业链的软硬件均值得持续跟踪；此外，宏观经济相关性高的顺周期方向也需要保持关注。商品方面，美元信用可靠性下降，黄金具备长期配置价值。

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

本基金本报告期末进行利润分配，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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,956,013.42	7,780,253.28
结算备付金		243,336.37	58,796.56
存出保证金		141,046.07	312,786.74
交易性金融资产	6.4.7.2	78,571,899.91	88,486,832.79
其中：股票投资		78,571,899.91	88,486,832.79
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	95,685.66
应收股利		188,375.70	4,053.67
应收申购款		37,887.44	61,554.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		85,138,558.91	96,799,963.62
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		4.68	5.05

应付赎回款		135,603.71	251,287.24
应付管理人报酬		35,100.05	41,444.36
应付托管费		7,020.04	8,288.88
应付销售服务费		12,751.25	16,235.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3,010.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	109,555.29	252,216.88
负债合计		300,035.02	572,488.51
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	67,661,016.99	78,509,761.29
未分配利润	6.4.7.8	17,177,506.90	17,717,713.82
净资产合计		84,838,523.89	96,227,475.11
负债和净资产总计		85,138,558.91	96,799,963.62

注：报告截止日 2023 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 1.2630 元，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 基金份额净值 1.2481 元；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数基金份额总额 67,661,016.99 份（其中 A 类 26,390,355.99 份，C 类 41,270,661.00 份）。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,063,004.86	-5,876,451.64
1.利息收入		25,247.11	30,611.40
其中：存款利息收入	6.4.7.9	25,247.11	30,611.40
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,359,588.70	908,160.62
其中：股票投资收益	6.4.7.10	333,520.74	-512,626.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,765.83	15,701.64
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	2,012.16	-

股利收益	6.4.7.14	1,022,289.97	1,405,085.31
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	1,676,277.80	-6,820,178.48
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	1,891.25	4,954.82
减：二、营业总支出		448,127.81	547,470.78
1.管理人报酬		228,425.41	282,302.87
2.托管费		45,685.16	56,460.57
3.销售服务费		85,587.49	99,631.61
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		57.88	0.03
8.其他费用	6.4.7.18	88,371.87	109,075.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,614,877.05	-6,423,922.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,614,877.05	-6,423,922.42
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,614,877.05	-6,423,922.42

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	78,509,761.29	-	17,717,713.82	96,227,475.11
二、本期期初净资产（基金净值）	78,509,761.29	-	17,717,713.82	96,227,475.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,848,744.30	-	-540,206.92	-11,388,951.22
（一）、综合收益总额	-	-	2,614,877.05	2,614,877.05

(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)	-10,848,744.30	-	-3,155,083.97	-14,003,828.27
其中: 1.基金申购款	7,807,951.33	-	2,256,731.33	10,064,682.66
2.基金赎回款	-18,656,695.63	-	-5,411,815.30	-24,068,510.93
(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)	67,661,016.99	-	17,177,506.90	84,838,523.89
项目	上年度可比期间 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	86,318,299.91	-	24,676,888.32	110,995,188.23

产（基金净值）				
---------	--	--	--	--

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、《资产管理产品相关会计处理规定》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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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

本基金本报告期无会计政策变更。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,956,013.42
等于：本金	5,954,867.37

加：应计利息	1,146.05
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	5,956,013.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	86,430,230.96	-	78,571,899.91	-7,858,331.05
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	86,430,230.96	-	78,571,899.91	-7,858,331.05

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 2023 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	1,175,220.00	-	-	-
其中：股指期货	1,175,220.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,175,220.00	-	-	-

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
IF2309	沪深 300 期货 IF2309 合约	1	1,151,700.00	-23,520.00
合计	-	-	-	-23,520.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-23,520.00
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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	162.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	34,925.86
其中：交易所市场	34,925.86
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,466.77
应付指数使用费	10,000.00
合计	109,555.29

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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	27,069,654.06	27,069,654.06
本期申购	2,591,154.21	2,591,154.21
本期赎回（以“-”号填列）	-3,270,452.28	-3,270,452.28
本期末	26,390,355.99	26,390,355.99

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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	51,440,107.23	51,440,107.23
本期申购	5,216,797.12	5,216,797.12
本期赎回（以“-”号填列）	-15,386,243.35	-15,386,243.35
本期末	41,270,661.00	41,270,661.00

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
上年度末	5,810,718.14	524,109.46	6,334,827.60
本期利润	411,989.20	412,806.27	824,795.47
本期基金份额交易产生的变动数	-147,551.02	-71,983.05	-219,534.07
其中：基金申购款	551,623.96	225,085.75	776,709.71
基金赎回款	-699,174.98	-297,068.80	-996,243.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,075,156.32	864,932.68	6,940,089.00

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,372,664.03	1,010,222.19	11,382,886.22
本期利润	526,610.05	1,263,471.53	1,790,081.58
本期基金份额交易产生的变动数	-2,022,448.51	-913,101.39	-2,935,549.90
其中：基金申购款	1,042,374.70	437,646.92	1,480,021.62
基金赎回款	-3,064,823.21	-1,350,748.31	-4,415,571.52
本期已分配利润	-	-	-

本期末	8,876,825.57	1,360,592.33	10,237,417.90
-----	--------------	--------------	---------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,456.72
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	2,713.54
其他	76.85
合计	25,247.11

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	25,208,989.50
减：卖出股票成本总额	24,822,225.46
减：交易费用	53,243.30
买卖股票差价收入	333,520.74

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,764.52
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	1,765.83

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,266.25

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,500.00
减：应计利息总额	1.31
减：交易费用	0.42
买卖债券差价收入	1,764.52

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	2,012.16

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,022,289.97
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	1,022,289.97

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	1,639,077.80
——股票投资	1,639,077.80
——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	37,200.00
——权证投资	-
——期货投资	37,200.00
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	1,676,277.80

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,891.25
合计	1,891.25

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 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	3,018.91
指数使用费	20,000.00
证券组合费	886.19
合计	88,371.87

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

根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

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

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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%

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	228,425.41	282,302.87
其中：支付销售机构的客户维护费	75,401.07	77,278.58

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,685.16	56,460.57

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 2023年1月1日至2023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	-	8,599.67	8,599.67
中信证券	-	17.31	17.31
华夏财富	-	4.65	4.65

合计	-	8,621.63	8,621.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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
合计	-	16,973.66	16,973.66

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 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	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	37.90%	-	28.94%	-

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	5,956,013.42	22,456.72	7,300,676.89	28,914.68

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 2023年1月1日至2023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	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	500	9,995.00
上年度可比期间 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
------	--------	------	------	-----	----------

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 2023 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 347,930.20 元，占基金资产净值的比例为 0.41%（2022 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 405,964.90 元，占基金资产净值的比例为 0.42%）。

于 2023 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 235,098.00 元，占基金资产净值的比例为 0.28%（2022 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 289,254.00 元，占基金资产净值的比例为 0.30%）。

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（2023 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
00493	国美零售	2023-04-03	重大事项	0.10	2023-07-18	0.09	3,337,000	412,370.53	323,047.96	-
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项	6.97	2023-07-03	7.40	2,000	11,717.64	13,940.00	-
45951	中国忠旺	2021-08-30	退市	-	-	-	48,800	81,764.25	-	-

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 2023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	-	-	-	-
交易性金融资产	-	21,210,868.11	-	21,210,868.11
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	72,975.92	-	72,975.92
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	21,283,844.03	-	21,283,844.03
以外币计价				

的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2022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	-	23,074,142.27	-	23,074,142.27
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	4,053.67	-	4,053.67
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	23,078,195.94	-	23,078,195.94
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	港币相对人民币升值 5%	1,064,192.20	1,153,909.80
	港币相对人民币贬值 5%	-1,064,192.20	-1,153,909.80

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	78,571,899.91	92.61	88,486,832.79	91.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	78,571,899.91	92.61	88,486,832.79	91.96

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-4,173,147.60	-4,709,713.67
+5%	4,173,147.60	4,709,713.67	

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	78,234,911.95
第二层次	336,987.96
第三层次	-
合计	78,571,899.91

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。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日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 2023 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	78,571,899.91	92.29
	其中：股票	78,571,899.91	92.29
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	6,199,349.79	7.28
8	其他各项资产	367,309.21	0.43
9	合计	85,138,558.91	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 21,210,868.11 元，占基金资产净值比例为 25.00%。

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	4,047,790.00	4.77
B	采矿业	3,140,567.00	3.70
C	制造业	19,496,762.79	22.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,493,087.00	1.76
E	建筑业	5,815,469.28	6.85
F	批发和零售业	5,713,425.41	6.73
G	交通运输、仓储和邮政业	1,785,696.00	2.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,944,613.22	5.83
J	金融业	6,016,616.00	7.09
K	房地产业	2,702,855.00	3.19
L	租赁和商务服务业	1,773,671.00	2.09
M	科学研究和技术服务业	221,966.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	140,693.70	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	67,819.40	0.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	57,361,031.80	67.61

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	7,998,987.84	9.43
非必需消费品	4,040,561.68	4.76
必需消费品	1,620,227.72	1.91
房地产	1,604,613.98	1.89

工业	1,596,847.23	1.88
信息技术	1,238,532.63	1.46
材料	1,197,467.61	1.41
保健	1,101,895.18	1.30
公用事业	708,177.45	0.83
金融	103,556.79	0.12
能源	-	-
合计	21,210,868.11	25.00

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	24,600	7,520,922.77	8.86
2	002714	牧原股份	51,600	2,174,940.00	2.56
3	601939	建设银行	285,800	1,789,108.00	2.11
4	600941	中国移动	17,800	1,660,740.00	1.96
5	300498	温氏股份	86,200	1,581,770.00	1.86
6	601668	中国建筑	264,100	1,515,934.00	1.79
7	601888	中国中免	11,900	1,315,307.00	1.55
8	601390	中国中铁	147,700	1,119,566.00	1.32
9	601318	中国平安	23,600	1,095,040.00	1.29
10	03690	美团-W	8,460	953,933.98	1.12
11	600938	中国海油	52,300	947,676.00	1.12
12	06808	高鑫零售	503,500	937,718.20	1.11
13	000002	万科 A	63,000	883,260.00	1.04
14	601186	中国铁建	89,100	877,635.00	1.03
15	601919	中远海控	91,250	857,750.00	1.01
16	06110	滔搏	125,000	782,530.53	0.92
17	002311	海大集团	16,400	768,176.00	0.91
18	03323	中国建材	170,000	755,470.41	0.89
19	600827	百联股份	50,300	672,511.00	0.79
20	600028	中国石化	105,700	672,252.00	0.79
21	600873	梅花生物	68,700	613,491.00	0.72
22	600036	招商银行	18,400	602,784.00	0.71
23	600019	宝钢股份	106,361	597,748.82	0.70
24	600859	王府井	29,500	583,805.00	0.69
25	002091	江苏国泰	76,500	576,810.00	0.68
26	01099	国药控股	24,400	551,159.64	0.65
27	600048	保利发展	40,800	531,624.00	0.63
28	601669	中国电建	90,100	517,174.00	0.61

29	002385	大北农	77,200	509,520.00	0.60
30	00788	中国铁塔	596,000	478,065.07	0.56
31	600519	贵州茅台	279	471,789.00	0.56
32	601618	中国中冶	117,200	465,284.00	0.55
33	601800	中国交建	40,900	446,219.00	0.53
34	02007	碧桂园	304,000	445,648.25	0.53
35	01109	华润置地	14,000	428,536.30	0.51
36	002594	比亚迪	1,600	413,232.00	0.49
37	09987	百胜中国	1,000	407,146.37	0.48
38	002416	爱施德	54,900	405,162.00	0.48
39	600104	上汽集团	28,300	401,011.00	0.47
40	601398	工商银行	81,200	391,384.00	0.46
41	600887	伊利股份	13,800	390,816.00	0.46
42	601857	中国石油	51,100	381,717.00	0.45
43	600309	万华化学	4,300	377,712.00	0.45
44	000725	京东方 A	91,800	375,462.00	0.44
45	688981	中芯国际	7,360	371,827.20	0.44
46	601899	紫金矿业	32,400	368,388.00	0.43
47	09878	汇通达网络	12,400	361,840.27	0.43
48	600153	建发股份	33,000	360,030.00	0.42
49	00960	龙湖集团	20,500	359,867.23	0.42
50	300750	宁德时代	1,560	356,912.40	0.42
51	600325	华发股份	36,000	354,600.00	0.42
52	00688	中国海外发展	22,500	354,316.91	0.42
53	600030	中信证券	17,590	347,930.20	0.41
54	000333	美的集团	5,700	335,844.00	0.40
55	600606	绿地控股	120,878	332,414.50	0.39
56	00493	国美零售	3,337,000	323,047.96	0.38
57	000932	华菱钢铁	67,600	322,452.00	0.38
58	000501	武商集团	32,300	319,447.00	0.38
59	600585	海螺水泥	13,200	313,368.00	0.37
60	601088	中国神华	9,800	301,350.00	0.36
61	00354	中国软件国际	66,000	299,993.85	0.35
62	600900	长江电力	13,500	297,810.00	0.35
63	000858	五粮液	1,800	294,426.00	0.35
64	000829	天音控股	32,500	293,800.00	0.35
65	002299	圣农发展	15,200	291,080.00	0.34
66	600729	重庆百货	9,200	289,248.00	0.34
67	001979	招商蛇口	22,000	286,660.00	0.34
68	601868	中国能建	119,217	278,967.78	0.33
69	002230	科大讯飞	4,100	278,636.00	0.33
70	000063	中兴通讯	6,100	277,794.00	0.33
71	601600	中国铝业	49,300	270,657.00	0.32

72	300226	上海钢联	8,297	268,822.80	0.32
73	000338	潍柴动力	21,500	267,890.00	0.32
74	600704	物产中大	53,800	265,772.00	0.31
75	000930	中粮科技	32,700	264,870.00	0.31
76	600170	上海建工	97,500	262,275.00	0.31
77	601985	中国核电	36,800	259,440.00	0.31
78	600383	金地集团	35,600	256,676.00	0.30
79	600271	航天信息	18,400	251,896.00	0.30
80	600837	海通证券	27,100	249,862.00	0.29
81	002352	顺丰控股	5,500	247,995.00	0.29
82	00696	中国民航信息网络	20,000	245,246.68	0.29
83	601728	中国电信	43,500	244,905.00	0.29
84	02319	蒙牛乳业	9,000	244,785.69	0.29
85	000651	格力电器	6,700	244,617.00	0.29
86	00992	联想集团	32,000	241,042.46	0.28
87	01958	北京汽车	137,500	240,867.27	0.28
88	002251	步步高	53,000	237,440.00	0.28
89	601288	农业银行	66,600	235,098.00	0.28
90	002419	天虹股份	40,100	234,585.00	0.28
91	600795	国电电力	59,300	227,119.00	0.27
92	600089	特变电工	9,700	216,213.00	0.25
93	00267	中信股份	25,000	215,512.83	0.25
94	03396	联想控股	32,100	214,863.75	0.25
95	600710	苏美达	25,000	214,000.00	0.25
96	00489	东风集团股份	64,000	211,244.06	0.25
97	603613	国联股份	5,648	208,580.64	0.25
98	02020	安踏体育	2,800	206,652.60	0.24
99	600755	厦门国贸	26,600	205,884.00	0.24
100	601988	中国银行	52,200	204,102.00	0.24
101	000709	河钢股份	89,000	201,140.00	0.24
102	601766	中国中车	30,800	200,200.00	0.24
103	01810	小米集团-W	20,200	199,649.24	0.24
104	000039	中集集团	28,950	199,465.50	0.24
105	600690	海尔智家	8,400	197,232.00	0.23
106	600362	江西铜业	10,200	193,596.00	0.23
107	002410	广联达	5,620	182,593.80	0.22
108	02688	新奥能源	2,000	179,970.50	0.21
109	000069	华侨城 A	40,900	179,960.00	0.21
110	000792	盐湖股份	9,300	178,281.00	0.21
111	601155	新城控股	12,300	177,243.00	0.21
112	600057	厦门象屿	20,300	176,610.00	0.21
113	601688	华泰证券	12,800	176,256.00	0.21

114	02331	李宁	4,500	174,876.56	0.21
115	300383	光环新网	16,200	174,150.00	0.21
116	600570	恒生电子	3,900	172,731.00	0.20
117	601012	隆基绿能	6,016	172,478.72	0.20
118	002493	荣盛石化	14,450	168,198.00	0.20
119	600346	恒力石化	11,600	166,228.00	0.20
120	600438	通威股份	4,800	164,688.00	0.19
121	00552	中国通信服务	46,000	163,706.77	0.19
122	600010	包钢股份	89,600	160,384.00	0.19
123	601816	京沪高铁	30,300	159,378.00	0.19
124	000625	长安汽车	12,290	158,909.70	0.19
125	600031	三一重工	9,500	157,985.00	0.19
126	00322	康师傅控股	14,000	157,216.03	0.19
127	601006	大秦铁路	21,000	156,030.00	0.18
128	600588	用友网络	7,600	155,800.00	0.18
129	600845	宝信软件	3,064	155,681.84	0.18
130	01378	中国宏桥	26,000	152,458.61	0.18
131	000100	TCL 科技	38,470	151,571.80	0.18
132	09633	农夫山泉	3,800	151,527.41	0.18
133	00175	吉利汽车	17,000	149,840.19	0.18
134	601211	国泰君安	10,700	149,693.00	0.18
135	601992	金隅集团	64,900	141,482.00	0.17
136	01093	石药集团	22,000	138,131.04	0.16
137	688111	金山办公	292	137,888.24	0.16
138	002373	千方科技	10,000	136,400.00	0.16
139	600808	马钢股份	53,000	136,210.00	0.16
140	601828	美凯龙	28,300	135,557.00	0.16
141	600096	云天化	7,900	134,853.00	0.16
142	000898	鞍钢股份	47,600	132,328.00	0.16
143	00384	中国燃气	16,000	132,322.57	0.16
144	02313	申洲国际	1,900	130,944.21	0.15
145	00656	复星国际	25,500	126,486.44	0.15
146	002092	中泰化学	19,600	126,420.00	0.15
147	002466	天齐锂业	1,800	125,838.00	0.15
148	601658	邮储银行	25,700	125,673.00	0.15
149	00135	昆仑能源	22,000	124,946.73	0.15
150	603259	药明康德	2,000	124,620.00	0.15
151	300454	深信服	1,100	124,575.00	0.15
152	600741	华域汽车	6,700	123,682.00	0.15
153	600718	东软集团	11,500	122,590.00	0.14
154	601898	中煤能源	14,100	119,004.00	0.14
155	601607	上海医药	5,300	118,773.00	0.14
156	002475	立讯精密	3,590	116,495.50	0.14

157	600886	国投电力	9,100	115,115.00	0.14
158	002065	东华软件	16,200	114,372.00	0.13
159	600584	长电科技	3,600	112,212.00	0.13
160	00881	中升控股	4,000	110,453.20	0.13
161	000701	厦门信达	16,600	110,390.00	0.13
162	03320	华润医药	17,500	110,038.32	0.13
163	601233	桐昆股份	8,000	106,000.00	0.12
164	300033	同花顺	600	105,168.00	0.12
165	01359	中国信达	144,000	103,556.79	0.12
166	002368	太极股份	2,500	102,925.00	0.12
167	600299	安迪苏	12,900	102,813.00	0.12
168	600803	新奥股份	5,400	102,492.00	0.12
169	600426	华鲁恒升	3,280	100,466.40	0.12
170	003816	中国广核	32,100	99,831.00	0.12
171	603993	洛阳钼业	18,700	99,671.00	0.12
172	000933	神火股份	7,600	98,800.00	0.12
173	00576	浙江沪杭甬	18,000	98,744.06	0.12
174	000776	广发证券	6,700	98,557.00	0.12
175	000488	晨鸣纸业	20,200	97,970.00	0.12
176	00836	华润电力	6,000	97,914.27	0.12
177	600958	东方证券	10,084	97,814.80	0.12
178	00268	金蝶国际	10,000	96,623.50	0.11
179	600196	复星医药	3,100	95,790.00	0.11
180	600276	恒瑞医药	1,964	94,075.60	0.11
181	000708	中信特钢	5,850	92,664.00	0.11
182	01799	新特能源	6,000	91,829.21	0.11
183	300012	华测检测	4,700	91,650.00	0.11
184	00392	北京控股	3,500	91,483.47	0.11
185	600143	金发科技	10,400	90,792.00	0.11
186	601138	工业富联	3,600	90,720.00	0.11
187	000630	铜陵有色	31,100	89,879.00	0.11
188	600352	浙江龙盛	9,500	88,825.00	0.10
189	000157	中联重科	13,100	88,425.00	0.10
190	002460	赣锋锂业	1,440	87,782.40	0.10
191	002129	TCL 中环	2,625	87,150.00	0.10
192	300496	中科创达	900	86,715.00	0.10
193	600141	兴发集团	3,900	86,658.00	0.10
194	000785	居然之家	22,700	86,487.00	0.10
195	000959	首钢股份	24,700	86,450.00	0.10
196	601168	西部矿业	8,200	86,182.00	0.10
197	01177	中国生物制药	27,000	84,886.70	0.10
198	000568	泸州老窖	400	83,828.00	0.10
199	01193	华润燃气	3,300	81,539.91	0.10

200	600655	豫园股份	11,800	80,948.00	0.10
201	000878	云南铜业	7,300	80,665.00	0.10
202	02689	玖龙纸业	18,000	80,156.94	0.09
203	600332	白云山	2,500	79,700.00	0.09
204	600027	华电国际	11,900	79,611.00	0.09
205	002415	海康威视	2,400	79,464.00	0.09
206	002304	洋河股份	600	78,810.00	0.09
207	000906	浙商中拓	8,800	78,496.00	0.09
208	000158	常山北明	9,700	78,473.00	0.09
209	000938	紫光股份	2,460	78,351.00	0.09
210	600297	广汇汽车	37,500	78,000.00	0.09
211	600295	鄂尔多斯	8,680	77,859.60	0.09
212	000425	徐工机械	11,500	77,855.00	0.09
213	600612	老凤祥	1,100	76,868.00	0.09
214	002078	太阳纸业	7,100	75,899.00	0.09
215	600219	南山铝业	24,900	75,198.00	0.09
216	002439	启明星辰	2,500	74,400.00	0.09
217	000830	鲁西化工	7,000	73,920.00	0.09
218	603799	华友钴业	1,600	73,456.00	0.09
219	600998	九州通	6,854	71,144.52	0.08
220	002432	九安医疗	2,000	70,420.00	0.08
221	000166	申万宏源	15,200	70,224.00	0.08
222	600177	雅戈尔	11,100	70,041.00	0.08
223	002268	电科网安	2,500	69,675.00	0.08
224	02269	药明生物	2,000	69,240.70	0.08
225	000807	云铝股份	5,400	68,742.00	0.08
226	002422	科伦药业	2,300	68,264.00	0.08
227	002202	金风科技	6,300	66,906.00	0.08
228	002601	龙佰集团	4,000	66,000.00	0.08
229	01308	海丰国际	5,000	65,921.57	0.08
230	02618	京东物流	5,800	65,346.25	0.08
231	600489	中金黄金	6,300	65,079.00	0.08
232	600850	电科数字	2,730	64,400.70	0.08
233	600536	中国软件	1,365	63,991.20	0.08
234	600398	海澜之家	9,300	63,984.00	0.08
235	600905	三峡能源	11,900	63,903.00	0.08
236	600522	中天科技	4,000	63,640.00	0.08
237	03808	中国重汽	4,500	63,146.41	0.07
238	02314	理文造纸	26,000	62,325.84	0.07
239	603927	中科软	1,600	61,696.00	0.07
240	002648	卫星化学	4,120	61,635.20	0.07
241	00144	招商局港口	6,000	61,182.59	0.07
242	01044	恒安国际	2,000	60,850.68	0.07

243	00152	深圳国际	9,500	60,435.79	0.07
244	300677	英科医疗	2,740	60,280.00	0.07
245	300760	迈瑞医疗	200	59,960.00	0.07
246	603501	韦尔股份	610	59,804.40	0.07
247	600415	小商品城	7,000	59,710.00	0.07
248	300122	智飞生物	1,350	59,670.00	0.07
249	02357	中航科工	17,000	59,559.91	0.07
250	00148	建滔集团	3,000	59,052.82	0.07
251	600058	五矿发展	6,000	58,980.00	0.07
252	002241	歌尔股份	3,300	58,575.00	0.07
253	600233	圆通速递	4,000	58,240.00	0.07
254	300682	朗新科技	2,500	58,200.00	0.07
255	603899	晨光股份	1,300	58,032.00	0.07
256	601633	长城汽车	2,300	57,891.00	0.07
257	000555	神州信息	4,700	57,810.00	0.07
258	600500	中化国际	10,260	57,045.60	0.07
259	000963	华东医药	1,300	56,381.00	0.07
260	000895	双汇发展	2,300	56,327.00	0.07
261	000960	锡业股份	3,600	55,980.00	0.07
262	601628	中国人寿	1,600	55,936.00	0.07
263	600809	山西汾酒	300	55,521.00	0.07
264	000027	深圳能源	8,400	55,356.00	0.07
265	600406	国电南瑞	2,390	55,209.00	0.07
266	002001	新和成	3,572	55,008.80	0.06
267	600893	航发动力	1,300	54,938.00	0.06
268	000661	长春高新	400	54,520.00	0.06
269	600801	华新水泥	4,400	54,340.00	0.06
270	601991	大唐发电	16,400	54,284.00	0.06
271	600079	人福医药	2,000	53,880.00	0.06
272	01313	华润水泥控股	18,000	53,603.92	0.06
273	603986	兆易创新	500	53,125.00	0.06
274	600111	北方稀土	2,200	52,756.00	0.06
275	601877	正泰电器	1,900	52,535.00	0.06
276	000538	云南白药	1,000	52,480.00	0.06
277	603225	新凤鸣	4,700	51,935.00	0.06
278	600547	山东黄金	2,200	51,656.00	0.06
279	600487	亨通光电	3,500	51,310.00	0.06
280	688599	天合光能	1,185	50,492.85	0.06
281	600760	中航沈飞	1,120	50,400.00	0.06
282	601872	招商轮船	8,700	50,373.00	0.06
283	601598	中国外运	10,800	50,328.00	0.06
284	01208	五矿资源	24,000	50,229.47	0.06
285	06618	京东健康	1,100	50,151.10	0.06

286	000301	东方盛虹	4,200	49,644.00	0.06
287	600989	宝丰能源	3,900	49,179.00	0.06
288	000626	远大控股	6,600	49,170.00	0.06
289	600567	山鹰国际	21,400	49,006.00	0.06
290	002064	华峰化学	7,100	48,706.00	0.06
291	600166	福田汽车	14,200	48,280.00	0.06
292	300999	金龙鱼	1,200	47,988.00	0.06
293	600623	华谊集团	7,700	47,971.00	0.06
294	002128	电投能源	3,600	47,592.00	0.06
295	01347	华虹半导体	2,000	47,205.38	0.06
296	600575	淮河能源	18,400	47,104.00	0.06
297	00867	康哲药业	4,000	47,057.86	0.06
298	00586	海螺创业	5,000	47,020.98	0.06
299	002185	华天科技	5,100	46,920.00	0.06
300	601216	君正集团	11,400	46,740.00	0.06
301	03800	协鑫科技	28,000	46,725.95	0.06
302	601866	中远海发	18,900	46,683.00	0.06
303	600021	上海电力	4,300	46,311.00	0.05
304	601995	中金公司	1,300	46,176.00	0.05
305	601238	广汽集团	4,300	44,806.00	0.05
306	00819	天能动力	6,000	44,752.91	0.05
307	600278	东方创业	5,900	44,722.00	0.05
308	002459	晶澳科技	1,068	44,535.60	0.05
309	600380	健康元	3,500	44,485.00	0.05
310	600026	中远海能	3,500	44,240.00	0.05
311	00189	东岳集团	8,000	43,222.42	0.05
312	002736	国信证券	4,900	42,777.00	0.05
313	00257	光大环境	15,000	42,733.77	0.05
314	600023	浙能电力	8,200	41,574.00	0.05
315	600418	江淮汽车	3,300	41,547.00	0.05
316	601319	中国人保	7,100	41,464.00	0.05
317	300003	乐普医疗	1,800	40,698.00	0.05
318	002156	通富微电	1,800	40,680.00	0.05
319	601881	中国银河	3,500	40,635.00	0.05
320	00570	中国中药	12,000	40,382.72	0.05
321	601989	中国重工	8,300	40,006.00	0.05
322	600482	中国动力	1,700	39,848.00	0.05
323	000513	丽珠集团	1,000	38,910.00	0.05
324	300124	汇川技术	600	38,526.00	0.05
325	000951	中国重汽	2,280	38,418.00	0.05
326	01066	威高股份	4,000	37,764.30	0.04
327	300015	爱尔眼科	2,028	37,619.40	0.04
328	002252	上海莱士	5,000	37,550.00	0.04

329	002049	紫光国微	400	37,300.00	0.04
330	600916	中国黄金	3,100	36,611.00	0.04
331	002532	天山铝业	6,100	36,539.00	0.04
332	03998	波司登	12,000	36,510.41	0.04
333	601066	中信建投	1,500	36,300.00	0.04
334	600150	中国船舶	1,100	36,201.00	0.04
335	000028	国药一致	830	36,196.30	0.04
336	600739	辽宁成大	2,700	35,505.00	0.04
337	000921	海信家电	1,300	35,035.00	0.04
338	600511	国药股份	900	34,965.00	0.04
339	600085	同仁堂	600	34,536.00	0.04
340	300888	稳健医疗	820	34,169.40	0.04
341	603858	步长制药	1,640	33,767.60	0.04
342	601615	明阳智能	2,000	33,760.00	0.04
343	01882	海天国际	2,000	33,707.59	0.04
344	00968	信义光能	4,000	33,375.68	0.04
345	000877	天山股份	4,100	33,374.00	0.04
346	002563	森马服饰	5,300	32,966.00	0.04
347	002030	达安基因	3,300	32,901.00	0.04
348	600223	福瑞达	3,200	32,832.00	0.04
349	002179	中航光电	720	32,652.00	0.04
349	301236	软通动力	1,200	32,652.00	0.04
351	600066	宇通客车	2,200	32,428.00	0.04
352	603939	益丰药房	860	31,820.00	0.04
353	002371	北方华创	100	31,765.00	0.04
354	603071	物产环能	1,900	31,521.00	0.04
355	002008	大族激光	1,200	31,440.00	0.04
356	600966	博汇纸业	5,300	31,376.00	0.04
357	688012	中微公司	200	31,290.00	0.04
358	600535	天士力	2,100	30,471.00	0.04
359	000999	华润三九	500	30,330.00	0.04
360	300014	亿纬锂能	500	30,250.00	0.04
361	603882	金域医学	400	30,200.00	0.04
362	600060	海信视像	1,200	29,700.00	0.04
363	600582	天地科技	5,000	29,150.00	0.03
364	600528	中铁工业	2,900	28,652.00	0.03
365	600436	片仔癀	100	28,636.00	0.03
366	688396	华润微	534	27,986.94	0.03
367	002701	奥瑞金	6,100	27,511.00	0.03
368	000062	深圳华强	2,400	27,408.00	0.03
369	000035	中国天楹	5,900	27,022.00	0.03
370	600210	紫江企业	5,000	26,600.00	0.03
371	600875	东方电气	1,400	26,110.00	0.03

372	600056	中国医药	2,000	25,960.00	0.03
373	688009	中国通号	4,424	25,659.20	0.03
374	600879	航天电子	2,900	24,621.00	0.03
375	600320	振华重工	6,600	24,618.00	0.03
376	000528	柳工	3,100	24,490.00	0.03
377	603233	大参林	859	24,060.59	0.03
378	603883	老百姓	800	23,880.00	0.03
379	600580	卧龙电驱	1,600	23,376.00	0.03
380	03692	翰森制药	2,000	23,233.90	0.03
381	002603	以岭药业	900	23,121.00	0.03
382	000553	安道麦 A	2,700	22,788.00	0.03
383	01070	T C L 电子	6,000	22,514.75	0.03
384	600206	有研新材	1,700	22,338.00	0.03
385	600662	外服控股	3,900	22,308.00	0.03
386	600025	华能水电	3,100	22,103.00	0.03
387	002831	裕同科技	900	21,951.00	0.03
388	688298	东方生物	576	21,726.72	0.03
389	300450	先导智能	600	21,702.00	0.03
390	603260	合盛硅业	300	21,006.00	0.02
391	601018	宁波港	6,100	20,679.00	0.02
392	600566	济川药业	700	20,328.00	0.02
393	600420	国药现代	1,800	20,322.00	0.02
394	600315	上海家化	700	20,307.00	0.02
395	000800	一汽解放	2,400	20,088.00	0.02
396	600761	安徽合力	1,000	19,930.00	0.02
397	300070	碧水源	3,700	19,832.00	0.02
398	002444	巨星科技	900	19,692.00	0.02
399	300979	华利集团	400	19,496.00	0.02
400	000550	江铃汽车	1,400	19,376.00	0.02
401	300782	卓胜微	200	19,326.00	0.02
402	601100	恒立液压	300	19,299.00	0.02
403	002511	中顺洁柔	1,700	18,955.00	0.02
404	600323	瀚蓝环境	1,000	18,930.00	0.02
405	600835	上海机电	1,100	18,898.00	0.02
406	600765	中航重机	700	18,557.00	0.02
407	600460	士兰微	600	18,162.00	0.02
408	03331	维达国际	1,000	17,978.61	0.02
409	300223	北京君正	200	17,662.00	0.02
410	600499	科达制造	1,500	17,040.00	0.02
411	688187	时代电气	400	16,744.00	0.02
412	002249	大洋电机	2,900	16,530.00	0.02
413	000519	中兵红箭	900	16,281.00	0.02
414	688303	大全能源	400	16,180.00	0.02

415	600038	中直股份	400	15,928.00	0.02
416	600372	中航电子	1,000	15,180.00	0.02
417	600967	内蒙一机	1,500	15,150.00	0.02
418	600685	中船防务	500	14,975.00	0.02
419	600927	永安期货	900	14,634.00	0.02
420	601298	青岛港	2,000	13,940.00	0.02
421	603160	汇顶科技	300	13,875.00	0.02
422	688223	晶科能源	970	13,638.20	0.02
423	03899	中集安瑞科	2,000	12,907.72	0.02
424	301039	中集车辆	900	11,907.00	0.01
425	000155	川能动力	800	11,520.00	0.01
426	603588	高能环境	1,140	10,681.80	0.01
427	601388	怡球资源	3,700	10,656.00	0.01
428	000885	城发环境	800	10,648.00	0.01
429	00817	中国金茂	10,000	10,602.77	0.01
430	00587	海螺环保	5,000	10,556.67	0.01
431	002266	浙富控股	2,500	10,325.00	0.01
432	688819	天能股份	276	10,167.84	0.01
433	601106	中国一重	2,900	9,744.00	0.01
434	603833	欧派家居	100	9,580.00	0.01
435	002034	旺能环境	600	9,486.00	0.01
436	00631	三一国际	1,000	9,459.51	0.01
437	603392	万泰生物	140	9,347.80	0.01
438	300355	蒙草生态	2,600	9,074.00	0.01
439	001289	龙源电力	400	9,000.00	0.01
440	603568	伟明环保	490	8,579.90	0.01
441	600475	华光环能	700	8,316.00	0.01
442	002573	清新环境	1,500	8,265.00	0.01
443	601038	一拖股份	700	8,218.00	0.01
444	600874	创业环保	1,300	7,618.00	0.01
445	300072	海新能科	2,100	7,182.00	0.01
446	00658	中国高速传动	3,000	6,748.89	0.01
447	600370	三房巷	2,500	6,700.00	0.01
448	003035	南网能源	800	5,696.00	0.01
449	01030	新城发展	4,000	5,642.52	0.01
450	300867	圣元环保	300	5,229.00	0.01
451	301109	军信股份	300	4,953.00	0.01
452	002645	华宏科技	400	4,904.00	0.01
453	002534	西子洁能	200	3,360.00	0.00
454	688728	格科微	200	3,164.00	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	300498	温氏股份	1,448,148.00	1.50
2	601888	中国中免	664,690.00	0.69
3	00700	腾讯控股	615,093.67	0.64
4	02007	碧桂园	561,741.34	0.58
5	002385	大北农	507,301.00	0.53
6	00493	国美零售	417,437.12	0.43
7	002714	牧原股份	394,817.00	0.41
8	03690	美团-W	368,235.74	0.38
9	000829	天音控股	320,217.00	0.33
10	002419	天虹股份	244,471.00	0.25
11	00656	复星国际	227,112.36	0.24
12	600859	王府井	210,529.00	0.22
13	601318	中国平安	187,344.00	0.19
14	03323	中国建材	182,191.83	0.19
15	601919	中远海控	168,301.00	0.17
16	06808	高鑫零售	166,627.60	0.17
17	02777	富力地产	155,315.65	0.16
18	000002	万科 A	151,960.00	0.16
19	601728	中国电信	149,735.00	0.16
20	601828	美凯龙	138,339.00	0.14

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	946,441.68	0.98
2	601939	建设银行	709,489.00	0.74
3	600028	中国石化	531,165.00	0.55
4	03690	美团-W	481,137.74	0.50
5	601390	中国中铁	479,867.00	0.50
6	002230	科大讯飞	431,764.00	0.45
7	300226	上海钢联	409,965.60	0.43
8	600737	中粮糖业	396,533.00	0.41
9	01099	国药控股	359,551.36	0.37
10	601186	中国铁建	348,231.00	0.36

11	002714	牧原股份	328,802.00	0.34
12	601857	中国石油	295,213.00	0.31
13	002697	红旗连锁	279,557.00	0.29
14	000998	隆平高科	254,675.00	0.26
15	603708	家家悦	247,336.00	0.26
16	600827	百联股份	247,062.00	0.26
17	601668	中国建筑	246,807.00	0.26
18	600941	中国移动	246,176.00	0.26
19	000417	合肥百货	235,411.00	0.24
20	002124	天邦食品	234,165.00	0.24

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	13,268,214.78
卖出股票收入（成交）总额	25,208,989.50

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

本基金在风险可控的前提下，根据基金合同规定投资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，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，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，主要采取复制策略，建设银行系标的指数成份股，该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	141,046.07
2	应收清算款	-
3	应收股利	188,375.70
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,887.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	367,309.21

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	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A	2,747	9,606.97	10,265,299.50	38.90%	16,125,056.49	61.10%
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	14,271	2,891.92	-	-	41,270,661.00	100.00%
合计	17,018	3,975.85	10,265,299.50	15.17%	57,395,717.49	84.83%

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	101,782.46	0.39%
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	85,727.81	0.21%
	合计	187,510.27	0.28%

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、基金投资和相关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	0~10
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2022 年 7 月 16 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§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	27,069,654.06	51,440,107.23
本报告期基金总申购份额	2,591,154.21	5,216,797.12
减:本报告期基金总赎回份额	3,270,452.28	15,386,243.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	26,390,355.99	41,270,661.00

§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,本基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
东方证券	1	18,482,677.18	48.43%	8,083.04	47.42%	-
广发证券	2	12,687,909.09	33.25%	5,731.33	33.62%	-
方正证券	2	6,989,864.13	18.32%	3,231.64	18.96%	-

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，本基金还选择了北京高华证券、长江证券、高华证券、国泰君安证券、华泰证券、西部证券、招商证券、中金公司、中信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
东方证券	3,525.18	34.34%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	6,741.07	65.66%	-	-	-	-	-	-

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公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
2	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金在 2023 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	2023-01-16
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	2023-01-19
4	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金因新增港股通交易日更新在 2023 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	2023-03-06
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	2023-03-15
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	2023-03-23

§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

二〇二三年八月三十日