

**华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式
证券投资基金
2020 年中期报告
2020 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：二〇二〇年八月二十九日

§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 2020 年 8 月 27 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 2020 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 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§12 备查文件目录.....	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金	
基金简称	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数	
基金主代码	007505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 7 月 16 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	62,736,642.53 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	28,454,321.52 份	34,282,321.01 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	本基金主要采用复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
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	贺倩
	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	北京市西城区复兴门内大街28号凯

	泰大厦B座8层	晨世贸中心东座F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	杨明辉	周慕冰

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（2020 年 1 月 1 日至 2020 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	2,324,718.79	2,864,764.21
本期利润	1,653,370.39	1,936,193.11
加权平均基金份额本期利润	0.0515	0.0460
本期加权平均净值利润率	5.03%	4.51%
本期基金份额净值增长率	5.87%	5.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 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	2,367,614.56	2,746,372.10
期末可供分配基金份额利润	0.0832	0.0801
期末基金资产净值	31,649,151.54	38,021,893.25
期末基金份额净值	1.1123	1.1091
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 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	11.23%	10.91%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.49%	0.91%	7.32%	140.29%	1.17%	-139.38%
过去三个月	15.59%	1.05%	13.28%	1.02%	2.31%	0.03%
过去六个月	5.87%	1.60%	2.86%	1.56%	3.01%	0.04%
自基金合同生效起至今	11.23%	1.24%	7.55%	1.22%	3.68%	0.02%

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	8.45%	0.91%	7.32%	0.92%	1.13%	-0.01%
过去三个月	15.51%	1.05%	13.28%	1.02%	2.23%	0.03%
过去六个月	5.71%	1.60%	2.86%	1.56%	2.85%	0.04%
自基金合同生效起至今	10.91%	1.24%	7.55%	1.22%	3.36%	0.02%

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

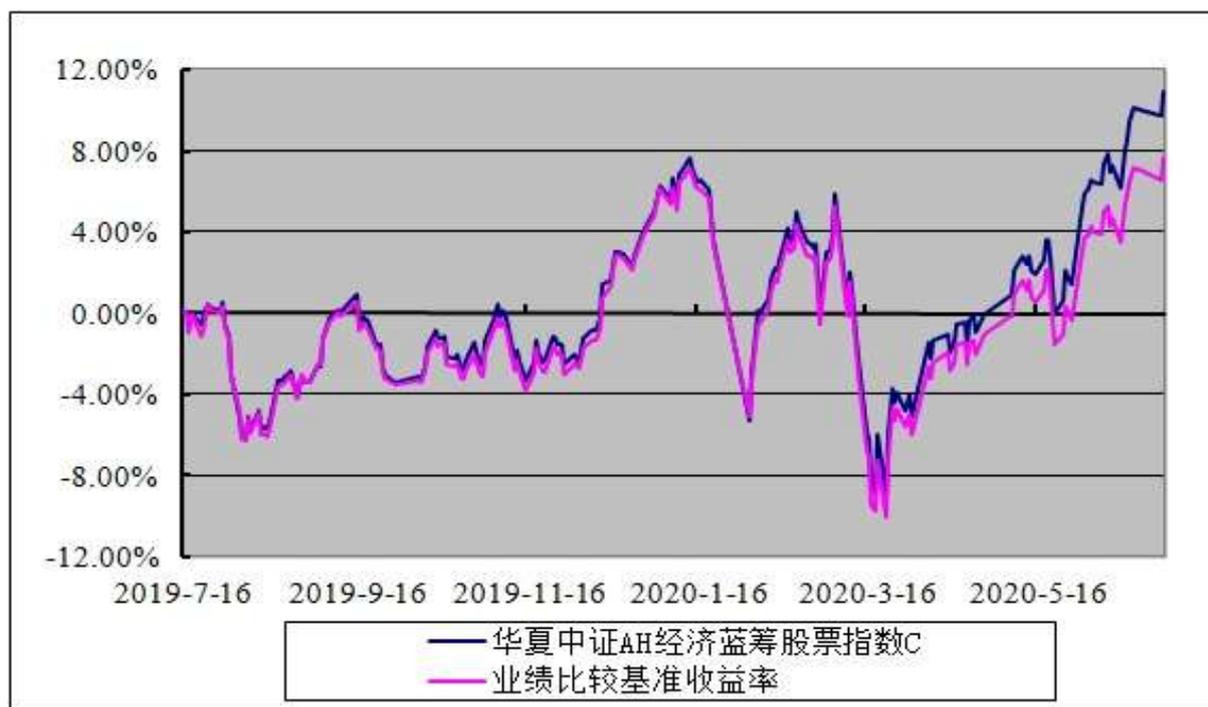
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019 年 7 月 16 日至 2020 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



注：①本基金合同于 2019 年 7 月 16 日生效。

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

§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，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF，初步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基金业绩统计报告，2020 年在基金分类排名中（截至 2020 年 6 月 30 日数据），华夏双债债券(C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（非 A 类）”中排序 1/123；华夏鼎利债券 (A 类)和华夏鼎沛债券 (A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（A 类）”中分别排序 2/248 和 6/248；华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金（A 类）”中排序 2/345；华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 9/22；华夏创新前沿股票和华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 2/203 和 10/203；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 1/10；华夏医疗健康混合(A 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（A 类）”中排

序 5/225；华夏乐享健康混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）”中排序 5/490；华夏磐泰混合(LOF)在“混合基金-偏债型基金-偏债型基金（A 类）”中分别排序 6/125；华夏移动互联混合（QDII）和华夏新时代混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 4/36 和 7/36；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数(C 类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非 A 类）”中排序 6/21，华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 3/78；华夏消费 ETF 及华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 7/35 和 4/35；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 5/53；华夏创成长 ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策略指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/17 和 3/17；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 9/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 3/28。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在中国证券报举办的第十七届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏上证 50ETF 荣获“三年期开放式指数型持续优胜金牛基金”奖。在证券时报社主办，在晨星资讯、上海证券和济安金信提供数据和研究支持的第十五届中国基金业明星基金奖评选中，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司”，华夏回报混合荣获“五年持续回报绝对收益策略明星基金”。

在客户服务方面，2020 年上半年度，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）华夏基金管家客户端部分基金上线定投止盈功能，同时对资料上传功能进行升级优化，为广大投资者管理定期定额交易、以及业务办理提供了便利；（2）华夏基金微信公众号上线货币基金收益播报推送功能，方便客户及时了解持有的货币基金收益变动情况；（3）与苏州农商银行、渤海银行、中天证券等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“难忘，因为不用记”、“凡是家人，都有户口本”、“人未动，心已跳”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		
庞亚平	本基金的基金经理、数量投资部总监	2019-07-16	-	11 年	统计学硕士，CFA。曾任中证指数有限公司研究部研究员、市场部主管。2016 年 1 月加入华夏基金

					管理有限公司，曾任数量投资部研究员、投资经理等。
--	--	--	--	--	--------------------------

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

上半年，新冠病毒疫情对全球经济造成严重冲击，为了应对由此导致的经济衰退和金融市场危机，各国政府和央行均出台了一系列货币宽松和财政刺激政策，经济也逐步回复到弱复苏阶段。国内方面，1 季度疫情控制为先，经济短期承受衰退压力，春节前后新冠疫情的暴发使得全国各地采取了严格的隔离防护措施，企业推迟复工，1-2 月生产、消费、投资等方面多项经济数据创下新低，

2 月底国外疫情开始蔓延，出口数据走弱。在疫情冲击下，中央多次强调“加大宏观政策对冲力度”，逆周期政策以财政为主货币为辅，其中财政政策要更加积极，适当提高财政赤字率，主要举措包括发行抗疫特别国债，增加地方政府专项债券规模；央行立场相对宽松，货币政策在稳健的基础上适度灵活。2 季度，疫情得到有效控制，复产复工稳步推进，宏观刺激政策推动经济数据持续改善奠定了全年经济逐级修复的态势，从结构上看，消费恢复相对落后于生产恢复，基建和房地产投资是经济修复的主要推动力。国际方面，欧美在 3 月进入疫情暴发期。美联储预计美国 2020 年全年 GDP 将下滑 6.5%，欧洲经济在进入疫情暴发前尚弱于美国，疫情暴发后更显疲软。为维持经济稳定，欧美各国货币政策依然相对宽松，但后续加大宽松空间有限。

市场方面，春节后首个交易日 A 股指数因疫情大幅下挫，此后由于市场预期疫情并未从根本上改变宏观基本面，A 股指数修复负面冲击影响，但 3 月国外疫情的暴发、叠加国际油价下调等偶然事件造成流动性紧张使得 A 股再度下跌，此后流动性危机解除加之国内经济长期向好的趋势不变，市场信心得到修复，进入 5 月，由于中美摩擦的加剧和货币宽松边际减弱，市场逻辑开始从流动性向基本面转换，6 月国内宏观数据持续改善验证经济复苏趋势，股市再度走强。整体看科技和消费在上半年较强势。港股延续 2019 年末走势，与 A 股出现分化，市场行业和主题相对单一以及香港发生的社会事件使得恒指跑输全球各大指数，目前估值仍处于历史低位水平。

基金投资运作方面，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 2020 年 6 月 30 日，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A 基金份额净值为 1.1123 元，本报告期份额净值增长率为 5.87%；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 基金份额净值为 1.1091 元，本报告期份额净值增长率为 5.71%，同期业绩比较基准增长率为 2.85%。

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，国内宏观经济将延续 2 季度以来的复苏态势，疫情防控或成常态，疫苗研发进度决定下半年复苏程度。从内部看，上半年经济恢复的主要拉动力是房地产、基建和高技术制造业投资，随着下半年财政政策的持续发力，基建投资增速有望上行。考虑到货币宽松有边际放缓迹象，房地产在需求释放后投资强度或将维持；制造业加速分化，高技术制造业在行业景气度上升和产业政策扶持下预计下半年将保持高增长。从外部看，外需虽有回升但仍面临压力，政治和政策的不确定性较大，逆全球化的趋势在疫情后仍在延续。国家逆周期政策将为经济复苏托底，财政和货币政策更注重协同，下半年财政支出力度有望加大，在全面通胀风险较小的情况下，货币政策也仍有下行空间。

对于证券市场，中国宏观经济修复快于欧美、流动性偏宽松、政策空间较宽裕的整体环境对 A 股较为有利，产业结构的调整升级或会使得市场具有更多结构性机会，新兴产业的高成长性公司和传统行业龙头更值得关注。港股方面，在估值处较低水平、美元走弱、中概股回归或激发市场活跃的情况下，港股作为吸收海外资金的优先通道仍具配置价值，风险主要在中美摩擦不确定性上。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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《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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,965,474.30	5,240,822.05
结算备付金		350.36	-
存出保证金		7,496.99	82,588.85
交易性金融资产	6.4.7.2	65,738,077.97	90,988,004.41
其中：股票投资		65,734,177.97	90,984,190.65
基金投资		-	-
债券投资		3,900.00	3,813.76
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		25,244.54	137,358.66
应收利息	6.4.7.5	850.03	1,986.02
应收股利		279,869.38	11,311.72
应收申购款		180,077.12	384,065.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		70,197,440.69	96,846,137.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		5.08	186.82
应付赎回款		374,036.80	1,290,304.76
应付管理人报酬		28,691.25	41,733.77
应付托管费		5,738.24	8,346.76
应付销售服务费		9,500.22	14,783.11
应付交易费用	6.4.7.7	33,579.78	16,804.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	74,844.53	120,014.72
负债合计		526,395.90	1,492,174.48
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	62,736,642.53	90,830,786.77
未分配利润	6.4.7.10	6,934,402.26	4,523,176.09
所有者权益合计		69,671,044.79	95,353,962.86
负债和所有者权益总计		70,197,440.69	96,846,137.34

注：报告截止日 2020 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 1.1123 元，华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C 基金份额净值 1.1091 元；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数基金份额总额 62,736,642.53 份（其中 A 类 28,454,321.52 份，C 类 34,282,321.01 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,058,742.14
1.利息收入		18,861.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,711.84
债券利息收入		149.88
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）		5,633,637.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,726,644.18
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	6,766.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-

贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	900,226.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,599,919.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	6,162.87
减：二、费用		469,178.64
1.管理人报酬		189,320.56
2.托管费		37,864.13
3.销售服务费		64,358.83
4.交易费用	6.4.7.20	88,592.76
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		-
7.其他费用	6.4.7.21	89,042.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,589,563.50
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,589,563.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	90,830,786.77	4,523,176.09	95,353,962.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,589,563.50	3,589,563.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-28,094,144.24	-1,178,337.33	-29,272,481.57
其中：1.基金申购款	23,750,989.26	41,326.48	23,792,315.74
2.基金赎回款	-51,845,133.50	-1,219,663.81	-53,064,797.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	62,736,642.53	6,934,402.26	69,671,044.79
-----------------	---------------	--------------	---------------

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。

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基金净值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 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2020 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	3,965,474.30
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	3,965,474.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	63,311,965.70	65,734,177.97	2,422,212.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,900.00	3,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	3,900.00	3,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	63,315,865.70	65,738,077.97	2,422,212.27

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	838.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	8.26

应收债券利息	0.32
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.40
合计	850.03

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	33,579.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	33,579.78

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	199.95
应付证券出借违约金	-
预提费用	64,644.58
应付指数使用费	10,000.00
合计	74,844.53

6.4.7.9 实收基金

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	38,205,250.34	38,205,250.34
本期申购	7,029,209.02	7,029,209.02
本期赎回（以“-”号填列）	-16,780,137.84	-16,780,137.84
本期末	28,454,321.52	28,454,321.52

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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	52,625,536.43	52,625,536.43
本期申购	16,721,780.24	16,721,780.24
本期赎回（以“-”号填列）	-35,064,995.66	-35,064,995.66
本期末	34,282,321.01	34,282,321.01

6.4.7.10 未分配利润

华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	188,738.18	1,745,857.58	1,934,595.76
本期利润	2,324,718.79	-671,348.40	1,653,370.39
本期基金份额交易产生的变动数	-145,842.41	-247,293.72	-393,136.13
其中：基金申购款	111,100.81	-71,848.76	39,252.05
基金赎回款	-256,943.22	-175,444.96	-432,388.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,367,614.56	827,215.46	3,194,830.02

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	188,167.97	2,400,412.36	2,588,580.33
本期利润	2,864,764.21	-928,571.10	1,936,193.11
本期基金份额交易产生的变动数	-306,560.08	-478,641.12	-785,201.20
其中：基金申购款	210,541.45	-208,467.02	2,074.43
基金赎回款	-517,101.53	-270,174.10	-787,275.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,746,372.10	993,200.14	3,739,572.24

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	活期存款利息收入	17,067.46
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	1,458.19	

其他	186.19
合计	18,711.84

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	48,282,136.65
减：卖出股票成本总额	43,555,492.47
买卖股票差价收入	4,726,644.18

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	199,907.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	189,252.00
减：应收利息总额	3,888.63
买卖债券差价收入	6,766.70

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	900,226.17
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	900,226.17

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-1,599,919.50
——股票投资	-1,599,305.74
——债券投资	-613.76
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,599,919.50

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	6,162.87
合计	6,162.87

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	88,592.76
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-

其中：申购费	-
赎回费	-
合计	88,592.76

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	3,997.78
指数使用费	20,000.00
其他	400.00
合计	89,042.36

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

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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例

中信证券	1,722,272.55	2.56%
------	--------------	-------

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

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 2020年1月1日至2020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	742.85	3.29%	742.85	2.21%

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 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	189,320.56
其中：支付销售机构的客户维护费	49,413.82

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
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	37,864.13

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 2020年1月1日至2020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	-	3,028.66	3,028.66
华夏财富	-	42.05	42.05
中信证券	-	8.98	8.98
合计	-	3,079.69	3,079.69

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
----	----

	2020年1月1日至2020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
期初持有的基金份额	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	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	35.15%	-

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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	3,965,474.30	17,067.46

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

无。

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

无。

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（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新发 流通 受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新发 流通 受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新发 流通 受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本总 额	期末 估值总 额	备注
128112	歌尔转 2	2020-06-12	2020-07-13	新发 流通 受限	100.00	100.00	39	3,900.00	3,900.00	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理

目标。

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

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 2020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	-	23,340,778.84	-	23,340,778.84
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	279,869.38	-	279,869.38
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	23,620,648.22	-	23,620,648.22
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-

应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2019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	-	32,529,861.04	-	32,529,861.04
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	11,311.72	-	11,311.72
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	32,541,172.76	-	32,541,172.76
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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	港币相对人民币升值 5%	1,181,032.41	1,627,058.64
	港币相对人民币贬值 5%	-1,181,032.41	-1,627,058.64

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	65,734,177.97	94.35	90,984,190.65	95.42
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,900.00	0.01	3,813.76	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	65,738,077.97	94.35	90,988,004.41	95.42

注：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。

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	+5%	3,535,282.07	4,969,966.29
	-5%	-3,535,282.07	-4,969,966.29

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

(2) 各层次金融工具公允价值

截至 2020 年 6 月 30 日止, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 65,738,077.97 元, 第二层次的余额为 0 元, 第三层次的余额为 0 元。(截至 2019 年 12 月 31 日止: 第一层次的余额为 90,988,004.41 元, 第二层次的余额为 0 元, 第三层次的余额为 0 元。)

(3) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票, 本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次, 于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票, 本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次, 于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

(4) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§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	65,734,177.97	93.64
	其中: 股票	65,734,177.97	93.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,900.00	0.01
	其中: 债券	3,900.00	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,965,824.66	5.65
8	其他各项资产	493,538.06	0.70
9	合计	70,197,440.69	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 23,340,778.84 元, 占基金资

产净值比例为 33.50%。

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	941,236.00	1.35
B	采矿业	1,704,293.60	2.45
C	制造业	16,706,779.33	23.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,042,748.80	1.50
E	建筑业	3,436,484.00	4.93
F	批发和零售业	5,833,447.80	8.37
G	交通运输、仓储和邮政业	1,833,011.50	2.63
H	住宿和餐饮业	387,697.00	0.56
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,423,554.10	2.04
J	金融业	4,863,043.00	6.98
K	房地产业	2,243,676.00	3.22
L	租赁和商务服务业	1,402,947.00	2.01
M	科学研究和技术服务业	110,256.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	30,525.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	433,700.00	0.62
S	综合	-	-
	合计	42,393,399.13	60.85

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（%）
通信服务	9,562,803.36	13.73
非必需消费品	2,750,317.62	3.95
必需消费品	2,255,109.80	3.24
房地产	2,177,106.61	3.12
信息技术	1,499,965.31	2.15
保健	1,482,517.68	2.13
材料	1,476,294.40	2.12
工业	1,110,112.78	1.59
公用事业	594,475.89	0.85
能源	354,323.38	0.51
金融	77,752.01	0.11
合计	23,340,778.84	33.50

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	19,200	8,744,470.73	12.55
2	601939	建设银行	253,000	1,596,430.00	2.29
3	600519	贵州茅台	900	1,316,592.00	1.89
4	03690	美团点评-W	7,400	1,161,950.49	1.67
5	600887	伊利股份	37,300	1,161,149.00	1.67
6	601318	中国平安	14,900	1,063,860.00	1.53
7	000002	万科A	39,400	1,029,916.00	1.48
8	03323	中国建材	136,000	1,024,879.68	1.47
9	600655	豫园股份	100,500	890,430.00	1.28
10	000858	五粮液	4,600	787,152.00	1.13
11	600859	王府井	16,900	769,795.00	1.10
12	01099	国药控股	42,400	768,400.34	1.10
13	601668	中国建筑	151,000	720,270.00	1.03
14	300498	温氏股份	33,020	719,836.00	1.03
15	601888	中国中免	4,600	708,538.00	1.02
16	02319	蒙牛乳业	26,000	702,983.42	1.01
17	06808	高鑫零售	54,000	653,073.06	0.94
18	002251	步步高	45,900	641,682.00	0.92
19	01918	融创中国	21,000	622,463.69	0.89
20	600028	中国石化	150,300	587,673.00	0.84
21	00267	中信股份	88,000	585,186.20	0.84
22	601390	中国中铁	115,200	578,304.00	0.83
23	601186	中国铁建	68,400	573,192.00	0.82
24	03969	中国通号	180,000	547,515.94	0.79
25	000333	美的集团	9,100	544,089.00	0.78
26	00941	中国移动	11,000	525,502.03	0.75
27	000338	潍柴动力	38,300	525,476.00	0.75
28	300226	上海钢联	6,560	515,616.00	0.74
29	601933	永辉超市	54,100	507,458.00	0.73
30	600050	中国联通	102,600	496,584.00	0.71
31	600729	重庆百货	15,200	474,544.00	0.68
32	02007	碧桂园	52,000	452,189.34	0.65
33	600019	宝钢股份	98,700	450,072.00	0.65
34	000829	天音控股	65,100	426,405.00	0.61
35	600585	海螺水泥	8,000	423,280.00	0.61
36	000651	格力电器	7,300	412,961.00	0.59
37	00960	龙湖集团	12,000	403,923.17	0.58
38	600606	绿地控股	64,600	399,228.00	0.57

39	601669	中国电建	114,400	395,824.00	0.57
40	600036	招商银行	11,000	370,920.00	0.53
41	601766	中国中车	65,000	362,050.00	0.52
42	600048	保利地产	24,400	360,632.00	0.52
43	000876	新希望	12,000	357,600.00	0.51
44	00883	中国海洋石油	45,000	354,323.38	0.51
45	601618	中国中冶	135,100	339,101.00	0.49
46	600104	上汽集团	19,600	333,004.00	0.48
47	00322	康师傅控股	30,000	329,386.46	0.47
48	002419	天虹股份	34,000	324,700.00	0.47
49	01109	华润置地	12,000	321,713.57	0.46
50	601857	中国石油	76,100	318,859.00	0.46
51	600694	大商股份	13,100	314,269.00	0.45
52	600325	华发股份	43,800	309,228.00	0.44
53	600029	南方航空	59,100	305,547.00	0.44
54	600153	建发股份	37,600	304,560.00	0.44
55	01958	北京汽车	99,500	304,472.39	0.44
56	000725	京东方 A	64,100	299,347.00	0.43
57	00788	中国铁塔	234,000	292,830.60	0.42
58	601899	紫金矿业	65,600	288,640.00	0.41
59	00493	国美零售	242,000	285,157.70	0.41
60	002304	洋河股份	2,700	283,878.00	0.41
61	000938	紫光股份	6,600	283,668.00	0.41
62	600690	海尔智家	15,900	281,430.00	0.40
63	06110	滔搏	30,000	271,291.68	0.39
64	600600	青岛啤酒	3,500	267,750.00	0.38
65	600030	中信证券	11,000	265,210.00	0.38
66	601006	大秦铁路	35,800	252,032.00	0.36
67	000100	TCL 科技	40,500	251,100.00	0.36
68	00992	联想集团	64,000	250,794.09	0.36
69	600031	三一重工	13,100	245,756.00	0.35
70	601288	农业银行	71,900	243,022.00	0.35
71	00291	华润啤酒	6,000	236,763.65	0.34
72	601800	中国交建	31,400	230,476.00	0.33
73	000895	双汇发展	5,000	230,450.00	0.33
74	601607	上海医药	12,500	229,750.00	0.33
75	600837	海通证券	18,200	228,956.00	0.33
76	601600	中国铝业	81,900	226,044.00	0.32
77	601088	中国神华	15,700	225,452.00	0.32
78	600754	锦江酒店	8,100	224,775.00	0.32
79	00151	中国旺旺	42,000	224,432.21	0.32
80	002714	牧原股份	2,700	221,400.00	0.32
81	601111	中国国航	32,600	215,486.00	0.31

82	600309	万华化学	4,300	214,957.00	0.31
83	600900	长江电力	11,200	212,128.00	0.30
84	601398	工商银行	41,900	208,662.00	0.30
85	600115	东方航空	48,900	206,358.00	0.30
86	600362	江西铜业	14,700	197,862.00	0.28
87	00813	世茂集团	6,500	194,745.41	0.28
88	601919	中远海控	55,100	191,197.00	0.27
89	600795	XD 国电电	102,200	189,070.00	0.27
90	600011	华能国际	44,800	189,056.00	0.27
91	00688	中国海外发展	8,500	182,071.43	0.26
92	601988	中国银行	52,200	181,656.00	0.26
93	600057	厦门象屿	32,900	180,292.00	0.26
94	300750	宁德时代	1,000	174,360.00	0.25
95	600138	中青旅	17,100	168,777.00	0.24
96	00175	吉利汽车	15,000	167,159.52	0.24
97	600068	葛洲坝	28,000	166,600.00	0.24
98	000157	中联重科	25,700	165,251.00	0.24
99	002594	比亚迪	2,300	165,140.00	0.24
100	600089	特变电工	24,100	163,157.00	0.23
101	600258	首旅酒店	10,600	162,922.00	0.23
102	002027	分众传媒	29,200	162,644.00	0.23
103	000709	河钢股份	79,000	161,160.00	0.23
104	600170	上海建工	51,200	157,184.00	0.23
105	603288	海天味业	1,240	154,256.00	0.22
106	000039	中集集团	21,300	153,999.00	0.22
107	002092	中泰化学	32,800	148,584.00	0.21
108	00981	中芯国际	6,000	147,977.28	0.21
109	01177	中国生物制药	11,000	146,698.46	0.21
110	001979	招商蛇口	8,800	144,672.00	0.21
111	002202	金风科技	14,500	144,565.00	0.21
112	600704	物产中大	34,300	144,403.00	0.21
113	601012	隆基股份	3,400	138,482.00	0.20
114	600755	XD 厦门国	20,500	135,300.00	0.19
115	601211	国泰君安	7,700	132,902.00	0.19
116	00780	同程艺龙	10,400	132,616.87	0.19
117	002183	怡亚通	24,700	132,392.00	0.19
118	600276	恒瑞医药	1,420	131,066.00	0.19
119	01093	石药集团	9,600	128,378.51	0.18
120	600741	华域汽车	6,100	126,819.00	0.18
121	03320	华润医药	30,500	124,533.84	0.18
122	00916	龙源电力	31,000	123,177.38	0.18
123	600808	马钢股份	45,800	118,164.00	0.17
124	600637	东方明珠	12,100	116,765.00	0.17

125	600886	国投电力	14,700	115,542.00	0.17
126	03800	保利协鑫能源	576,000	115,224.98	0.17
127	601688	华泰证券	6,000	112,800.00	0.16
128	601992	金隅集团	36,600	111,996.00	0.16
129	02688	新奥能源	1,400	111,512.76	0.16
130	600352	浙江龙盛	8,700	111,273.00	0.16
131	000425	徐工机械	18,700	110,517.00	0.16
132	00489	东风集团股份	26,000	109,959.91	0.16
133	600027	华电国际	30,900	105,678.00	0.15
134	601985	中国核电	25,700	105,113.00	0.15
135	000630	铜陵有色	54,000	104,220.00	0.15
136	01313	华润水泥控股	12,000	104,022.55	0.15
137	01810	小米集团-W	8,800	103,211.41	0.15
138	600282	南钢股份	31,900	103,037.00	0.15
139	601117	中国化学	18,700	102,476.00	0.15
140	000401	冀东水泥	6,300	101,052.00	0.15
141	00135	昆仑能源	22,000	100,880.31	0.14
142	600839	四川长虹	35,000	100,450.00	0.14
143	002352	顺丰控股	1,800	98,460.00	0.14
144	000825	太钢不锈	29,300	97,276.00	0.14
145	000778	新兴铸管	28,300	97,069.00	0.14
146	600584	长电科技	3,100	96,937.00	0.14
147	600022	山东钢铁	71,800	92,622.00	0.13
148	03898	中车时代电气	5,100	91,773.32	0.13
149	600196	复星医药	2,700	91,395.00	0.13
150	000898	鞍钢股份	37,300	91,385.00	0.13
151	000932	华菱钢铁	24,200	91,234.00	0.13
152	600406	国电南瑞	4,500	91,125.00	0.13
153	01378	中国宏桥	29,000	91,124.77	0.13
154	600782	新钢股份	22,300	90,984.00	0.13
155	600801	华新水泥	3,800	90,098.00	0.13
156	02689	玖龙纸业	14,000	89,645.00	0.13
157	601866	中远海发	48,300	88,872.00	0.13
158	002415	海康威视	2,900	88,015.00	0.13
159	002475	立讯精密	1,690	86,781.50	0.12
160	603993	洛阳钼业	23,600	86,612.00	0.12
161	01169	海尔电器	4,000	85,680.67	0.12
162	00144	招商局港口	10,000	83,671.10	0.12
163	01044	恒安国际	1,500	83,168.71	0.12
164	00148	建滔集团	4,500	82,620.65	0.12
165	600346	恒力石化	5,900	82,600.00	0.12
166	600999	招商证券	3,700	81,215.00	0.12
167	601727	上海电气	16,000	80,640.00	0.12

168	600959	江苏有线	21,400	80,464.00	0.12
169	000776	广发证券	5,600	79,072.00	0.11
170	002110	三钢闽光	11,700	77,922.00	0.11
171	01359	中国信达	56,000	77,752.01	0.11
172	600373	中文传媒	6,600	77,748.00	0.11
173	600219	南山铝业	37,800	76,734.00	0.11
174	601877	正泰电器	2,900	76,415.00	0.11
175	000063	中兴通讯	1,900	76,247.00	0.11
176	600018	上港集团	17,800	74,760.00	0.11
177	03808	中国重汽	4,000	73,257.89	0.11
178	600009	上海机场	1,000	72,070.00	0.10
179	601233	桐昆股份	5,600	71,456.00	0.10
180	00392	北京控股	3,000	70,974.29	0.10
181	000963	华东医药	2,800	70,840.00	0.10
182	002241	歌尔股份	2,400	70,464.00	0.10
183	601989	中国重工	17,600	70,400.00	0.10
184	000830	鲁西化工	9,400	70,124.00	0.10
185	01193	华润燃气	2,000	68,964.72	0.10
186	002078	太阳纸业	7,200	68,544.00	0.10
187	600332	白云山	2,100	67,893.00	0.10
188	00152	深圳国际	6,000	67,631.10	0.10
189	600660	福耀玻璃	3,200	66,784.00	0.10
190	00836	华润电力	8,000	66,571.51	0.10
191	002180	纳思达	2,000	65,820.00	0.09
192	600567	山鹰纸业	22,300	65,785.00	0.09
193	601018	宁波港	18,400	65,688.00	0.09
194	000538	云南白药	700	65,667.00	0.09
195	000166	申万宏源	13,000	65,650.00	0.09
196	00363	上海实业控股	6,000	65,329.23	0.09
197	600547	山东黄金	1,780	65,183.60	0.09
198	02018	瑞声科技	1,500	65,151.11	0.09
199	601598	中国外运	20,100	64,923.00	0.09
200	600039	四川路桥	16,900	64,558.00	0.09
201	600516	方大炭素	10,200	64,056.00	0.09
202	01066	威高股份	4,000	62,990.82	0.09
203	600500	中化国际	12,400	62,744.00	0.09
204	02020	安踏体育	1,000	62,479.30	0.09
205	603858	步长制药	2,140	61,739.00	0.09
206	600958	东方证券	6,500	61,685.00	0.09
207	00570	中国中药	18,000	61,492.78	0.09
208	03933	联邦制药	10,000	61,200.48	0.09
209	600739	辽宁成大	3,200	60,576.00	0.09
210	03396	联想控股	7,300	60,346.41	0.09

211	000703	恒逸石化	6,550	59,801.50	0.09
212	06862	海底捞	2,000	59,738.98	0.09
213	600177	雅戈尔	9,900	59,004.00	0.08
214	002422	科伦药业	2,800	58,800.00	0.08
215	600307	酒钢宏兴	37,800	58,212.00	0.08
216	000960	锡业股份	6,800	58,208.00	0.08
217	002001	新 和 成	2,000	58,200.00	0.08
218	600820	隧道股份	10,300	58,195.00	0.08
219	600546	山煤国际	4,900	57,575.00	0.08
220	601628	中国人寿	2,100	57,141.00	0.08
221	02382	舜宇光学科技	500	56,633.28	0.08
222	600426	华鲁恒升	3,200	56,576.00	0.08
223	603259	药明康德	560	54,096.00	0.08
224	600037	歌华有线	3,500	53,200.00	0.08
225	600176	中国巨石	5,800	53,070.00	0.08
226	600096	云天化	11,100	52,725.00	0.08
227	01208	五矿资源	36,000	52,614.14	0.08
228	00384	中国燃气	2,400	52,394.92	0.08
229	600998	九州通	2,800	52,136.00	0.07
230	000625	长安汽车	4,700	51,700.00	0.07
231	600026	中远海能	8,000	51,680.00	0.07
232	02313	申洲国际	600	51,189.18	0.07
233	600023	浙能电力	14,500	50,895.00	0.07
234	002081	金 螳 螂	6,400	50,304.00	0.07
235	601098	中南传媒	4,700	49,726.00	0.07
236	01347	华虹半导体	2,000	49,143.07	0.07
237	002739	万达电影	3,200	48,864.00	0.07
238	600535	天士力	3,000	48,660.00	0.07
239	600489	中金黄金	5,300	48,442.00	0.07
240	000513	丽珠集团	1,000	48,010.00	0.07
241	002493	荣盛石化	3,900	47,970.00	0.07
242	003816	中国广核	16,100	47,656.00	0.07
243	000717	韶钢松山	12,500	47,500.00	0.07
244	600710	苏美达	10,900	47,306.00	0.07
245	600380	XD 健康元	2,900	47,096.00	0.07
246	601928	凤凰传媒	6,800	46,240.00	0.07
247	02128	中国联塑	5,000	46,037.38	0.07
248	601633	长城汽车	5,900	45,548.00	0.07
249	000028	国药一致	1,000	45,010.00	0.06
250	300433	蓝思科技	1,600	44,864.00	0.06
251	600511	国药股份	1,100	44,737.00	0.06
252	600893	航发动力	1,900	44,612.00	0.06
253	000878	云南铜业	4,200	44,562.00	0.06

254	000050	深天马 A	2,900	44,544.00	0.06
255	002236	大华股份	2,300	44,183.00	0.06
256	000951	中国重汽	1,400	43,764.00	0.06
257	000661	长春高新	100	43,530.00	0.06
258	00581	中国东方集团	22,000	42,401.88	0.06
259	600497	驰宏锌锗	12,300	42,312.00	0.06
260	00867	康哲药业	5,000	41,698.54	0.06
261	02357	中航科工	13,000	41,680.27	0.06
262	600100	同方股份	5,700	41,553.00	0.06
263	600711	盛屯矿业	8,000	41,120.00	0.06
264	000623	吉林敖东	2,600	40,898.00	0.06
265	002091	江苏国泰	6,700	40,535.00	0.06
266	00881	中升控股	1,000	39,186.58	0.06
267	600582	天地科技	13,300	38,969.00	0.06
268	600875	东方电气	4,400	38,940.00	0.06
269	02314	理文造纸	10,000	37,999.10	0.05
270	000999	华润三九	1,300	37,947.00	0.05
271	600271	航天信息	2,300	37,352.00	0.05
272	02186	绿叶制药	8,500	36,802.50	0.05
273	600056	中国医药	2,600	36,790.00	0.05
274	601658	邮储银行	8,000	36,560.00	0.05
275	600569	安阳钢铁	17,700	35,931.00	0.05
276	601816	京沪高铁	5,700	35,511.00	0.05
277	600703	三安光电	1,400	35,000.00	0.05
278	600757	长江传媒	6,700	34,103.00	0.05
279	000034	神州数码	1,400	34,076.00	0.05
280	01333	中国忠旺	25,200	33,607.28	0.05
281	03311	中国建筑国际	8,000	33,029.99	0.05
282	300133	华策影视	4,500	32,625.00	0.05
283	600085	同仁堂	1,200	32,544.00	0.05
284	002120	韵达股份	1,330	32,518.50	0.05
285	600062	华润双鹤	2,400	31,728.00	0.05
286	000156	华数传媒	2,900	31,407.00	0.05
287	01530	三生制药	3,500	31,394.93	0.05
288	000977	浪潮信息	800	31,344.00	0.04
289	601929	吉视传媒	14,400	30,816.00	0.04
290	300760	迈瑞医疗	100	30,570.00	0.04
291	002607	中公教育	1,100	30,525.00	0.04
292	600572	康恩贝	5,500	30,250.00	0.04
293	600977	中国电影	2,300	30,199.00	0.04
294	600126	杭钢股份	2,900	30,160.00	0.04
295	600713	南京医药	6,800	29,580.00	0.04
296	002736	国信证券	2,600	29,380.00	0.04

297	600420	现代制药	3,000	28,890.00	0.04
298	000423	东阿阿胶	800	28,648.00	0.04
299	600787	中储股份	6,400	28,096.00	0.04
300	600566	济川药业	1,100	28,006.00	0.04
301	601003	柳钢股份	6,300	27,909.00	0.04
302	002019	亿帆医药	1,200	27,564.00	0.04
303	000553	安道麦 A	3,000	27,060.00	0.04
304	002294	信立泰	900	26,694.00	0.04
305	002727	一心堂	700	25,977.00	0.04
306	600058	五矿发展	4,300	25,972.00	0.04
307	601138	工业富联	1,700	25,755.00	0.04
308	03331	维达国际	1,000	25,302.29	0.04
309	601881	中国银河	2,200	25,234.00	0.04
310	600812	华北制药	1,900	24,491.00	0.04
311	600150	中国船舶	1,400	24,416.00	0.04
312	600295	鄂尔多斯	3,400	23,970.00	0.03
313	600315	上海家化	500	23,950.00	0.03
314	600398	海澜之家	3,900	22,698.00	0.03
315	00656	复星国际	2,500	22,516.30	0.03
316	01888	建滔积层板	3,000	21,347.09	0.03
317	002127	南极电商	1,000	21,170.00	0.03
318	000665	湖北广电	4,000	20,920.00	0.03
319	300284	苏交科	2,800	20,832.00	0.03
320	601212	白银有色	8,100	20,655.00	0.03
321	600377	宁沪高速	2,100	20,601.00	0.03
322	603883	老百姓	200	20,008.00	0.03
323	300012	华测检测	1,000	19,760.00	0.03
324	603233	大参林	240	19,492.80	0.03
325	01896	猫眼娱乐	1,800	19,434.35	0.03
326	603825	华扬联众	600	19,290.00	0.03
327	00460	四环医药	28,000	18,926.48	0.03
328	600981	汇鸿集团	6,000	18,840.00	0.03
329	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.03
330	600350	山东高速	3,000	18,420.00	0.03
331	600648	外高桥	1,300	18,382.00	0.03
332	601949	中国出版	3,500	18,375.00	0.03
333	601811	新华文轩	1,800	18,306.00	0.03
334	600415	小商品城	3,700	18,019.00	0.03
335	601238	广汽集团	2,000	18,000.00	0.03
336	601231	环旭电子	800	17,472.00	0.03
337	002252	上海莱士	2,000	16,920.00	0.02
338	603899	晨光文具	300	16,380.00	0.02
339	600025	华能水电	4,200	15,918.00	0.02

340	603018	中设集团	1,600	15,568.00	0.02
341	601900	南方传媒	1,700	15,368.00	0.02
342	600626	申达股份	3,000	15,030.00	0.02
343	601319	中国人保	2,300	14,812.00	0.02
344	600989	宝丰能源	1,500	12,630.00	0.02
345	002556	辉隆股份	1,500	12,390.00	0.02
346	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.02
347	600956	新天绿能	2,320	11,692.80	0.02
348	600996	贵广网络	1,600	11,408.00	0.02
349	600278	东方创业	1,200	11,124.00	0.02
350	000061	农产品	1,500	11,115.00	0.02
351	000708	中信特钢	650	11,108.50	0.02
352	601298	青岛港	1,900	10,792.00	0.02
353	002441	众业达	1,300	10,387.00	0.01
354	000062	深圳华强	700	10,178.00	0.01
355	002938	鹏鼎控股	200	10,012.00	0.01
356	300251	光线传媒	900	9,819.00	0.01
357	600299	安迪苏	700	8,554.00	0.01
358	300845	N 捷安	470	8,286.10	0.01
359	601066	中信建投	200	7,876.00	0.01
360	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
361	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01

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	03690	美团点评-W	1,128,572.36	1.18
2	00700	腾讯控股	1,117,839.25	1.17
3	601939	建设银行	993,357.00	1.04
4	601318	中国平安	584,556.00	0.61
5	03969	中国通号	562,741.46	0.59
6	300498	温氏股份	397,479.00	0.42
7	01099	国药控股	366,924.74	0.38
8	600694	大商股份	334,482.00	0.35
9	000002	万科A	312,296.00	0.33
10	600325	华发股份	304,466.00	0.32
11	00493	国美零售	301,291.37	0.32
12	06110	滔搏	279,428.29	0.29
13	600036	招商银行	226,923.00	0.24

14	600887	伊利股份	207,400.00	0.22
15	002714	牧原股份	194,117.00	0.20
16	03323	中国建材	168,327.59	0.18
17	600028	中国石化	161,643.00	0.17
18	601669	中国电建	158,642.00	0.17
19	600048	保利地产	156,884.00	0.16
20	02319	蒙牛乳业	155,915.13	0.16

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	6,705,480.36	7.03
2	000564	供销大集	1,746,675.00	1.83
3	600859	王府井	1,716,958.31	1.80
4	000501	鄂武商 A	1,223,878.00	1.28
5	03323	中国建材	1,002,982.49	1.05
6	00606	中国粮油控股	741,193.23	0.78
7	002251	步步高	603,067.00	0.63
8	00881	中升控股	561,097.29	0.59
9	600546	山煤国际	541,887.00	0.57
10	600887	伊利股份	538,444.00	0.56
11	600729	重庆百货	498,132.00	0.52
12	000002	万科 A	475,941.00	0.50
13	600655	豫园股份	472,712.00	0.50
14	06808	高鑫零售	459,756.65	0.48
15	01918	融创中国	452,331.81	0.47
16	000100	TCL 科技	451,363.00	0.47
17	601668	中国建筑	430,683.00	0.45
18	601939	建设银行	420,118.00	0.44
19	01816	中广核电力	414,853.69	0.44
20	000829	天音控股	410,295.00	0.43

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

买入股票的成本（成交）总额	19,904,785.53
卖出股票的收入（成交）总额	48,282,136.65

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,900.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,900.00	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128112	歌尔转 2	39	3,900.00	0.01
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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	7,496.99
2	应收证券清算款	25,244.54
3	应收股利	279,869.38
4	应收利息	850.03
5	应收申购款	180,077.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	493,538.06

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	1,701	16,728.00	10,718,079.33	37.67%	17,736,242.19	62.33%
华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	13,479	2,543.39	-	-	34,282,321.01	100.00%
合计	15,180	4,132.85	10,718,079.33	17.08%	52,018,563.20	82.92%

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	480,732.80	1.69%
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	284,325.81	0.83%
	合计	765,058.61	1.22%

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	10~50
	华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数 C	10~50
	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	10~50
	合计	10~50

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	15.94%	10,000,000.00	15.94%	不少于三年

基金管理人高级管理人员	253,246.49	0.40%	-	-	-
基金经理等人员	122,165.07	0.19%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,377,856.25	16.54%	10,000,000.00	15.94%	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
本报告期期初基金份额总额	38,205,250.34	52,625,536.43
本报告期基金总申购份额	7,029,209.02	16,721,780.24
减：本报告期基金总赎回份额	16,780,137.84	35,064,995.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	28,454,321.52	34,282,321.01

§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，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本基金管理人于 2020 年 4 月 1 日发布公告，张德根先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关责令改正的行政监管措施，公司已按要求改正并报告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
西部证券	1	28,053,654.78	41.69%	12,101.30	53.61%	-
国泰君安证券	2	22,645,127.16	33.65%	3,311.06	14.67%	-
方正证券	2	14,876,651.62	22.11%	6,416.99	28.43%	-
中信证券	9	1,722,272.55	2.56%	742.85	3.29%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了北京高华证券、长江证券、东方证券、广发证券、华泰证券、招商证券、中金公司的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，中信证券的部分交易单元、招商证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
西部证券	330,854.00	92.66%	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-
方正证券	26,222.22	7.34%	-	-
中信证券	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金在 2020 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	2020-01-15
2	华夏基金管理有限公司关于根据国家延长春节假期通知及交易所休市安排等调整旗下基金春节后业务办理日期的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-30
3	华夏基金管理有限公司关于旗下公募基金 2019 年年报延缓审计与披露的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-26
4	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-01

§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

二〇二〇年八月二十九日