

华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数

证券投资基金（QDII）

2021 年第 2 季度报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏恒生互联网科技业 ETF（QDII）
场内简称	恒生互联（扩位简称：恒生互联网 ETF）
基金主代码	513330
交易代码	513330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 26 日
报告期末基金份额总额	10,843,480,000.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略，替代性策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，金融衍生产品投资策略等。
业绩比较基准	恒生互联网科技业指数收益率（使用估值汇率折算）
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	JPMorgan Chase Bank, National Association
境外资产托管人中文名称	摩根大通银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2021年4月1日-2021年6月30日)
1.本期已实现收益	-117,332,620.36
2.本期利润	-136,247,909.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0146
4.期末基金资产净值	9,031,517,961.88
5.期末基金份额净值	0.8329

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.11%	1.64%	-3.09%	1.64%	-0.02%	0.00%
自基金合同生效起至今	-16.71%	2.03%	-19.85%	2.16%	3.14%	-0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年1月26日至2021年6月30日)



注：①本基金合同于2021年1月26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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐猛	本基金的基金经理、投委会成员	2021-01-26	-	18年	硕士。曾任财富证券助理研究员，原中关村证券研究员等。2006年2月加入华夏基金管理有限公司。曾任数量投资部基金经理助理、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2016年1月29日至2016年3月28日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年3月12日至2021年2月1日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年3月12日至2021年2月1日期间）等。

注：①上述任职日期、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 公平交易专项说明

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，本公司严格执行了《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，本基金出现 1 次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，为本基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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香港恒生互联网科技业指数，该指数反映在香港上市、主要经营信息科技业务证券的整体表现，采用流通市场加权法计算，而每只成份股的权重上限设定为 10%。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。

2 季度，美国、欧洲等主要经济体的制造业景气度呈现回升态势，新冠病毒疫情在部分国家和地区出现较大反弹，拖累全球经济复苏的步伐。面对较大的通货膨胀压力，美联储认为通胀压力是阶段性的，继续维持宽松的货币政策。国内方面，国内经济继续复苏，企业盈利能力增强，货币政策逐步回归正常化。中国香港市场受到境外发达市场和 A 股市场的共同影响，同时在国内互联网行业反垄断的背景下，部分互联网龙头企业出现了较大波动，恒生互联网科技业指数整体呈现震荡走势。

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。在本季度的成份股调整中，在香港上市的百度和哔哩哔哩纳入到标的指数成份股中。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括中信证券股份有限公司、中信建投股份有限公司、招商证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年6月30日，本基金份额净值为0.8329元，本报告期份额净值增长率为-3.11%，同期经估值汇率调整的业绩比较基准增长率为-3.09%。本基金本报告期跟踪偏离度为-0.02%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为基金尚处于建仓期，基金组合的结构与指数结构尚存在差异等产生的差异。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,488,921,080.90	93.70
	其中：普通股	8,488,921,080.90	93.70
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-

	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	499,156,633.75	5.51
8	其他各项资产	71,297,127.14	0.79
9	合计	9,059,374,841.79	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 5,419,368,986.90 元，占基金资产净值比例为 60.01%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
中国香港	8,488,921,080.90	93.99
合计	8,488,921,080.90	93.99

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	3,489,070,527.06	38.63
非必需消费品	2,541,822,067.15	28.14
通信服务	2,414,114,832.31	26.73
工业	43,913,654.38	0.49
保健	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
能源	-	-
合计	8,488,921,080.90	93.99

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	MEITUAN	美团	03690	香港	中国香港	3,370,200.00	898,490,035.53	9.95
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴集团控股有限公司	09988	香港	中国香港	4,819,000.00	882,154,574.40	9.77
3	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	00700	香港	中国香港	1,679,700.00	816,224,549.18	9.04
4	XIAOMI CORP	小米集团	01810	香港	中国香港	36,125,600.00	811,603,509.70	8.99
5	KUAISHOU TECHNOLOGY	快手科技	01024	香港	中国香港	4,955,300.00	803,200,533.48	8.89
6	JD.COM INC	京东集团股份有限公司	09618	香港	中国香港	2,628,950.00	668,061,497.07	7.40
7	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL CORP	中芯国际集成电路制造有限公司	00981	香港	中国香港	25,427,500.00	505,669,369.38	5.60
8	LENOVO GROUP LTD	联想集团有限公司	00992	香港	中国香港	41,094,000.00	305,347,914.99	3.38

9	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	金蝶国际软件集团有限公司	00268	香港	中国香港	13,811,000.00	302,810,428.79	3.35
10	NETEASE INC	网易公司	09999	香港	中国香港	1,742,600.00	255,051,940.75	2.82

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	股指期货	HSTECH Futures Jul21	-	-
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
HCTN1 HKG	HSTECH Futures Jul21	1642	554,776,109.93	75,402.00
公允价值变动总额合计				75,402.00
股指期货投资本期收益				7,047,229.34
股指期货投资本期公允价值变动				-4,350,205.63

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,814,148.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	6,444,258.35
4	应收利息	38,720.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,297,127.14

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	8,199,480,000.00
报告期期间基金总申购份额	2,846,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	202,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	10,843,480,000.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2021年4月2日发布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。

2021年4月7日发布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。

2021年4月9日发布华夏基金管理有限公司公告。

2021年4月9日发布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。

2021年4月21日发布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。

2021年5月8日发布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。

2021年5月12日发布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。

2021年5月13日发布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。

2021年5月14日发布华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回业务的公告。

2021年5月19日发布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。

2021年5月25日发布华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告。

2021年5月28日发布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。

2021年6月4日发布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。

2021年6月9日发布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。

2021年6月17日发布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。

2021年6月18日发布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。

2021年6月19日发布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。

2021年6月28日发布华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申

购、赎回业务的公告。

2、其他相关信息

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，目前旗下管理上证 50ETF(510050)、300ETF 基金(510330)、MSCIA 股 ETF(512990)、500ETF 基金(512500)、中小 100(159902)、双创基金(159783)、创业板 HX(159957)、科创 50ETF(588000)、中证 1000(159845)、央企改革 ETF(512950)、四川国改(159962)、浙江国资 ETF(515760)、战略新兴 ETF(512770)、5GETF(515050)、人工智能 AIETF(515070)、芯片 ETF(159995)、新能源车 ETF(515030)、智能车(159888)、高端装备 ETF(516320)、大湾区(159983)、沪港深 ETF(517170)、消费 ETF 基金(510630)、金融地产 ETF(510650)、医药卫生 ETF(510660)、食品饮料 ETF(515170)、券商 ETF 基金(515010)、银行 ETF 华夏(515020)、房地产 ETF 基金(515060)、大数据 50ETF(516000)、生物科技 ETF(516500)、新能源 80ETF(516850)、游戏 ETF(159869)、有色 50ETF(516650)、创蓝筹(159966)、创成长(159967)、恒生 ETF(513660)、恒生 ETF(159920)、恒生科技指数 ETF(513180)、恒生互联网 ETF(513330)、H 股 50(159850)、日经 ETF(513520)、纳斯达克 ETF(513300)、中期信用 ETF(511280)、豆粕 ETF(159985)、黄金 ETF9999(518850)，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《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 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 QDII 混合基金（A 类）中华夏新时代混合（QDII）排序第 1/36、华夏移动互联网混合（QDII）排序第 4/36；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票排序第 2/36；在消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏新兴消费混合(A 类)排序第 2/21；在

标准股票型基金（A类）中华夏潜龙精选股票排序第 37/226；在绝对收益目标基金（A类）中华夏回报混合(A类)排序第 25/139、华夏回报二号混合排序第 27/139；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%60%）（A类）中华夏军工安全混合排序第 39/491；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A类）中华夏高端制造混合排序第 15/491、华夏稳盛混合排序第 54/491；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A类）中华夏行业景气混合排序第 9/566、华夏行业龙头混合排序第 36/566；在偏股型基金（股票上限 80%）（A类）中华夏经典混合排序第 11/128；在偏股型基金（股票上限 95%）（A类）中华夏兴和混合排序第 11/168、华夏兴华混合(A类)排序第 32/168、华夏大盘精选混合(A类)排序第 40/168；在偏债型基金（A类）中华夏睿磐泰茂混合(A类)排序第 44/149。FOF类产品中，在养老目标风险 FOF（权益资产 0-30%）（A类）中华夏稳健养老一年持有混合（FOF）排序第 4/20；在 QDII 混合基金（A类）中华夏全球聚享（QDII）（A类）排序第 10/36；

固收与固收+产品：在普通债券型基金（可投转债）（A类）中华夏聚利债券排序第 1/196、华夏双债债券(A类)排序第 3/196、华夏债券(A/B类)排序第 12/196；在可转换债券型基金（A类）中华夏可转债增强债券(A类)排序第 3/34；在定期开放式纯债债券型基金（摊余成本法）（A类）中华夏恒泰 64 个月定开债券排序第 12/73；在短期纯债债券型基金（A类）中华夏短债债券(A类)排序第 12/53；在偏债型基金（A类）中华夏永康添福混合排序第 18/149；在普通债券型基金（二级）（A类）中华夏安康债券(A类)排序第 40/248、华夏鼎利债券(A类)排序第 41/248。在 QDII 债券型基金（非 A类）中华夏收益债券（QDII）（A类)(美元)排序第 2/35、华夏大中华信用债券（QDII）（A类）（美元）排序第 4/35；

指数与量化产品：在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 1/22、华夏创蓝筹 ETF 排序第 6/22；在规模指数股票 ETF 基金中华夏创业板 ETF 排序第 1/90、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 排序第 26/90；在行业指数股票 ETF 基金中华夏消费 ETF 排序第 4/39、华夏医药 ETF 排序第 5/39；在增强规模指数股票型基金（A类）中华夏中证 500 指数增强(A类)排序第 6/93；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 3/88、华夏中证四川国改 ETF 排序第 8/88、华夏战略新兴成指 ETF 排序第 11/88。

在客户服务方面，2 季度，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）华夏基金直销上线邮储银行卡直连支付方式，进一步拓展了支付渠道；（2）管家客户端上线理财小管家和微信登录功能，方便客户及时了解市场观点、投资者教育等信息,也为客户提供了多样的登录方式；（3）与众惠基金等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“发个暗号，看多少人在嗑这对 CP？”、“我是真的追不上”、“风往哪吹”等活动，为客户提供了多样化的投资

者教育和关怀服务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 3、《华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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。

9.2 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。

9.3 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

二〇二一年七月二十日